

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 2023 年中期报告

2023 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：2023 年 08 月 31 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2023年8月29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2023年01月01日起至06月30日止。

1.2 目录	
§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	63
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	63
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	63

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	63
§ 8 基金份额持有人信息.....	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
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.....	66
§ 9 开放式基金份额变动.....	66
§ 10 重大事件揭示.....	66
10.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变.....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
10.8 其他重大事件.....	69
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
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.....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§ 12 备查文件目录.....	71
12.1 备查文件目录.....	71
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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）	462,941,627.00
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

注：扩位证券简称：长三角ETF。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、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	朱萍
	联系电话	021-28932888	021-31888888
	电子邮箱	service@99fund.com	zhup02@spdb.com.cn
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	上海市黄浦区外马路728号	上海市博成路1388号浦银中心A栋	
邮政编码	200010	200126	
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	上海市黄浦区外马路728号 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(2023年01月01日 - 2023年06月30日)
本期已实现收益	-5,474,640.93
本期利润	12,227,572.49
加权平均基金份额本期利润	0.0266
本期加权平均净值利润率	2.63%
本期基金份额净值增长率	2.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)
期末可供分配利润	-6,614,171.53

期末可供分配基金份额利润	-0.0143
期末基金资产净值	456,327,455.47
期末基金份额净值	0.9857
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.43%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

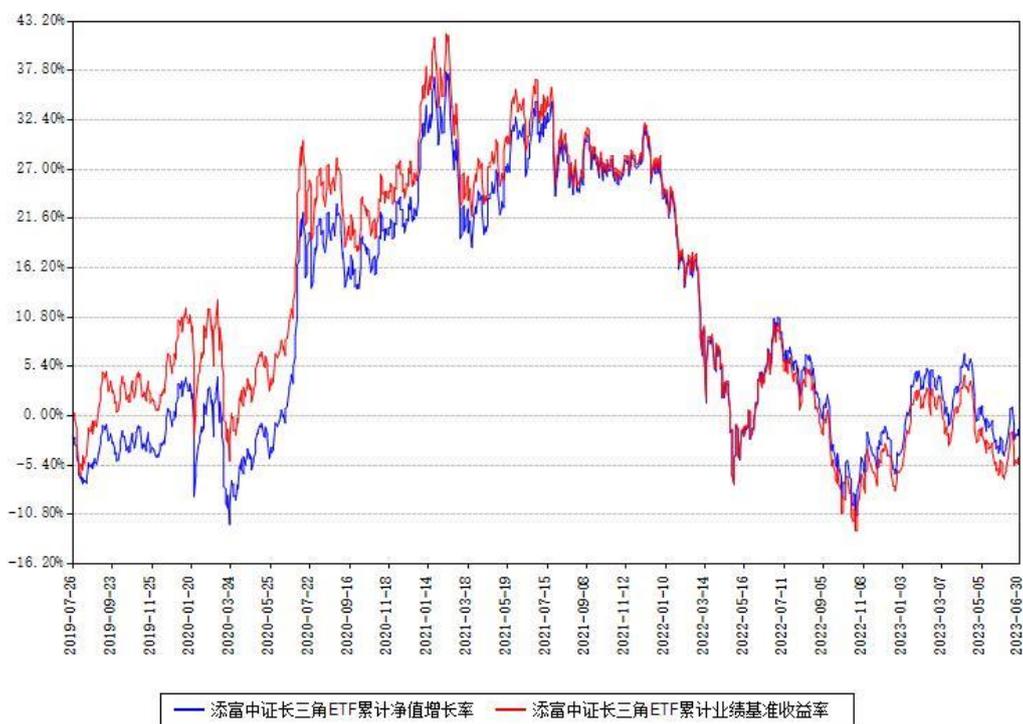
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.74%	0.94%	2.09%	0.98%	0.65%	-0.04%
过去三个月	-4.94%	0.91%	-5.89%	0.92%	0.95%	-0.01%
过去六个月	2.65%	0.89%	1.41%	0.90%	1.24%	-0.01%
过去一年	-10.59%	1.01%	-12.89%	1.02%	2.30%	-0.01%
过去三年	-6.48%	1.22%	-15.25%	1.23%	8.77%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	-1.43%	1.23%	-4.55%	1.25%	3.12%	-0.02%

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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2019年07月26日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于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、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。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、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2023上半年，汇添富基金新成立27只公开募集证券投资基金，包括10只股票型基金、9只混合型基金、8只债券型基金。截至2023年6月30日，公司共管理297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		
乐无穹	本基金的基金经理	2019年07月26日		9	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。 从业经历：2014年7月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。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7月26日至今任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。2021年4月

					<p>29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 29</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 28 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 6 月 13 日至今任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基金经理。2022 年 7 月 29 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月 7 日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的基金经理。2023 年 5 月 24 日至今任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 19 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注:1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”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合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、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

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行T检验。对于未通过T检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上,本基金管理人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,本基金管理人管理的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25次,投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控,事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析,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

2023年上半年,资本市场先在经济复苏背景下显现出修复行情,二季度市场整体显著

回调。

上半年美联储累计加息三次，将联邦基金目标利率提升至 5.00%-5.25%区间。3 月议息会议声明文件对未来继续加息的表述有所弱化，5 月暗示后续加息暂缓但年内仍较难降息。市场普遍预期本轮加息周期接近尾声，但转向降息周期仍然需要一定时间。

全球来看，海外通胀回落速度较为缓慢，美元指数二季度阶段性走强，人民币兑美元贬值压力加大。北向资金二季度小幅净流入，较一季度显著放缓。

国内来看，3 月两会召开，仍然坚持以稳增长为中心，加强协同，共同促进高质量发展。经济数据在二季度普遍表现疲软。GDP 增速低于市场预期。6 月官方制造业 PMI 数据 49，较前值小幅企稳，但仍低于 50。1-5 月规模以上工业企业营业收入累计同比增长 0.1%，利润累计同比下滑 18.8%，相较 1-4 月累计营收增速下滑、累计利润增速降幅有所收窄。国内经济整体仍处于弱复苏阶段，内需修复动力不足、外需增长压力较大。经济发展模式转型阶段存在压力和挑战。在稳增长压力较大的背景下，政策层面有望持续发力。6 月 MLF 下调 10 个基点，随后一年期、五年期 LPR 均下调 10 个基点，有望减轻企业融资成本、居民债务负担压力。

资本市场方面，新一轮科技创新话题引发热议，信息技术领域表现强势，智能化相关子板块体现出较强的爆发力，并有向产业各领域扩散的态势。市场认知科技创新市场前景广阔。二季度市场有所回调，行业主题结构性分化显著。一季度表现强势的计算机、通信等板块在 4 月和 5 月显著回调，6 月开始重新受到市场关注。银行、证券等金融类资产则是 4 月表现强势之后进入回调。当前科技创新和中特估仍是市场重点关注的资本市场投资主线，对不同偏好的资金有差异化的吸引力。

“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。长三角 ETF 及其联接基金是投资于长三角区域龙头上市企业的指数产品，覆盖行业主要包括金融、医药、电子等，能够帮助投资者把握长三角区域发展带来的主题投资机遇。

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 2.65%。同期业绩比较基准收益率为 1.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济呈现弱复苏状态，复苏强度低于年初预期。分项来看，工业制造和投资相对具有韧性，消费和出口较为疲弱。但居民消费倾向有抬升迹象，结合收入提升预期，下半年内需动能有望出现改善。国内政策基调仍以稳增长为主，尽管难有强刺激，但或许可以期待整体托底和结构性的支持政策。

全球来看，美国通胀超预期回落，加息周期步入尾声成为市场共识，不排除下半年仍有加息的可能性。通胀数据及通胀预期仍然是加息节奏的关键指标。

资本市场上半年整体表现为震荡修复。业绩角度来看，A股整体盈利增速尚未明显改善，结构分化仍然较为显著，且与股价表现存在一定的错位。信息技术领域在全球智能化浪潮的背景下获得资金关注，长期市场空间充分，但短期能体现出实际业绩增长的比例有限。于此同时低估值高分红类的资产也获得了较多资金流入。创新成长和具备安全边界的低估值资产，形成了两种较为极端的投资偏好，预计仍然会是下半年市场的关注焦点。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，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。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

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、基金费用开支以及利润分配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。

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、财务会计报告相关内容、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：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,538,323.03	9,476,309.11
结算备付金		2,421,621.04	2,412,495.26
存出保证金		1,250,173.69	1,414,134.11
交易性金融资产	6.4.7.2	444,702,713.95	435,414,096.72
其中：股票投资		444,702,713.95	435,381,390.27
基金投资		-	-
债券投资		-	32,706.45
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
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		456,912,831.71	448,717,035.20
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		202,429.25	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		55,251.30	57,297.27
应付托管费		18,417.10	19,099.12
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.90	0.59
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	309,277.69	230,554.54
负债合计		585,376.24	306,951.52
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	462,941,627.00	466,941,627.00
未分配利润	6.4.7.9	-6,614,171.53	-18,531,543.32
净资产合计		456,327,455.47	448,410,083.68
负债和净资产总计		456,912,831.71	448,717,035.20

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9857 元，基金份额总额 462,941,627.00 份。

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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30	2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30

		日	日
一、营业总收入		12,846,065.18	-93,523,801.14
1. 利息收入		38,217.33	136,965.51
其中：存款利息收入	6.4.7.10	38,217.33	71,756.39
债券利息收入		-	-
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		-	65,209.12
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,910,363.08	-11,355,011.02
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-9,582,000.09	-12,933,226.55
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	72,289.91	113,907.24
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-450,479.88	-3,234,164.19
股利收益	6.4.7.17	5,049,826.98	4,698,472.48
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	17,702,213.42	-82,515,306.54
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	15,997.51	209,550.91
减：二、营业总支出		618,492.69	703,687.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	346,571.16	396,946.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	115,523.74	132,315.49
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		1,785.23	234.83
8. 其他费用	6.4.7.21	154,612.56	174,191.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,227,572.49	-94,227,488.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,227,572.49	-94,227,488.94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		12,227,572.49	-94,227,488.94

6.3 净资产（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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	466,941,627.00	-18,531,543.32	448,410,083.68
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	466,941,627.00	-18,531,543.32	448,410,083.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,000,000.00	11,917,371.79	7,917,371.79
（一）、综合收益总额	-	12,227,572.49	12,227,572.49
（二）、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）	-4,000,000.00	-310,200.70	-4,310,200.70
其中：1. 基金申购款	10,000,000.00	-123,676.99	9,876,323.01
2. 基金赎回款	-14,000,000.00	-186,523.71	-14,186,523.71
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	462,941,627.00	-6,614,171.53	456,327,455.47
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	582,941,627.00	162,676,010.39	745,617,637.39
加：会计政策变更	-	-	-

二、本期期初净资产(基金净值)	582,941,627.00	162,676,010.39	745,617,637.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-122,000,000.00	-115,495,002.98	-237,495,002.98
(一)、综合收益总额	-	-94,227,488.94	-94,227,488.94
(二)、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)	-122,000,000.00	-21,267,514.04	-143,267,514.04
其中：1. 基金申购款	38,000,000.00	5,356,539.04	43,356,539.04
2. 基金赎回款	-160,000,000.00	-26,624,053.08	-186,624,053.08
(三)、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)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	460,941,627.00	47,181,007.41	508,122,634.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张暉</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中证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号文《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2019年7月26日生效。首次设立基金募集规模为6,428,941,627.00份基金份额,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)出具安永华明(2019)验字第60466941_A01号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式,

存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、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）。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为：中证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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员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 3 号《半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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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

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。

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资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。对证券投资基金在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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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法》、《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。

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。

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 2023年06月30日
活期存款	8,538,323.03
等于：本金	8,537,358.14
加：应计利息	964.89
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	8,538,323.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	472,300,994.98	-	444,702,713.95	-
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	472,300,994.98	-	444,702,713.95	27,598,281.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	10,290,420.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	10,290,420.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,290,420.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买)	合约市值	公允价值变动
----	----	--------	------	--------

		/卖)		
IF2307	IF2307	9	10,342,080.00	51,660.00
合计				51,660.00
减：可抵销期货暂收款				51,660.00
净额				-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

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 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

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 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	-
应付交易费用	119,975.13
其中：交易所市场	119,975.13
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	94,795.19

应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	35,000.00
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	309,277.69

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	466,941,627.00	466,941,627.00
本期申购	10,000,000.00	10,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-14,000,000.00	-14,000,000.00
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	462,941,627.00	462,941,627.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 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
本期期初	173,713,972.96	-192,245,516.28	-18,531,543.32
本期利润	-5,474,640.93	17,702,213.42	12,227,572.49
本期基金份额交易产生的变动数	-1,641,136.67	1,330,935.97	-310,200.70
其中：基金申购款	3,598,784.54	-3,722,461.53	-123,676.99
基金赎回款	-5,239,921.21	5,053,397.50	-186,523.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	166,598,195.36	-173,212,366.89	-6,614,171.53

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	17,178.22
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	20,934.26
其他	104.85
合计	38,217.33

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 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
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,924,031.90
股票投资收益——赎回差价收入	-657,968.19
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	-9,582,000.09

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	91,045,080.50
减：卖出股票成本总额	99,732,180.56
减：交易费用	236,931.84
买卖股票差价收入	-8,924,031.90

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
赎回基金份额对价总额	14,186,523.71
减：现金支付赎回款总额	5,240,054.71
减：赎回股票成本总额	9,604,437.19
减：交易费用	-

赎回差价收入	-657,968.19
--------	-------------

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	387.70
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	71,902.21
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	72,289.91

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	663,034.94
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	590,700.00
减：应计利息总额	406.20
减：交易费用	26.53
买卖债券差价收入	71,902.21

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

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——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 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 2023年01月01日至2023年06月30日
外汇期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	-450,479.88

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	5,049,826.98
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	5,049,826.98

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1. 交易性金融资产	17,427,593.42
——股票投资	17,427,593.42
——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	274,620.00
——权证投资	-
——期货投资	274,620.00
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	17,702,213.42

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	15,997.51
其他	-
合计	15,997.51

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	310.00
指数使用费	70,000.00
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	154,612.56

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
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东
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	该基金是本基金的联接基金

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	65,077,611.14	35.64	189,065,407.28	68.17

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 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	106,645.06	16.08	650,898.80	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	46,941.48	36.63	40,243.54	33.54
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	136,331.53	83.20	122,444.17	98.40

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	346,571.16	396,946.42
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

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至 2023年06月30日	2022年01月01日至 2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	115,523.74	132,315.49

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 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
	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	2,486,000.00	1,685.26	-	-

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

单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日				
---------------------------------------	--	--	--	--

关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位: 股)	出借期限 (单位: 天)	费率	利息收入	期末 证券 出借 业务 余额	期末 应收 利息 余额
				-	-		-	-	-	-
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位: 股)	出借期限 (单位: 天)	费率	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	20220111000006 92	天 合 光 能	202 2年 01 月 11 日	627,900. 00	10,000.0 0	14	3.6 0	879.06	-	-
东方 证券	20220125000118 88	天 合 光 能	202 2年 01 月 25 日	691,700. 00	10,000.0 0	14	3.6 0	968.38	-	-
东方 证券	20220208000152 82	天 合 光 能	202 2年 02 月 08 日	600,300. 00	10,000.0 0	14	3.6 0	840.42	-	-
东方 证券	20220222000137 05	天 合 光 能	202 2年 02 月	634,000. 00	10,000.0 0	14	3.6 0	887.60	-	-

			22日							
东方证券	2022030800013188	天合光能	2022年03月08日	731,900.00	10,000.00	14	3.60	1,024.66	-	-

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
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	48,915,000.00	10.57	53,055,000.00	11.36

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	8,538,323.03	17,178.22	10,279,273.35	22,650.17

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
				-	-
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
东方证券承销保荐有限公司	600958	东方证券	原股东优先配售	61,516.00	520,425.36

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

本基金根据基金合同和招募说明书约定的投资策略，按照标的指数的成份股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理人的股东东方证券发行的股票东方证券，和基金托管人浦发银行发行的股票浦发银行。于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 402,716.00 股，持有浦发银行 451,983.00 股。（于上年度可比期间，本基金按照指数权重比例持有东方证券 224,716.00 股，持有浦发银行 757,356.00 股。）

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

6.4.12 期末（2023 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名	成功认购日	受限期	流通受	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

	称			限 类 型			股)			
001286	陕西能源	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	
001287	中电港	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	612	7,270.56	12,864.24	
001328	登康口腔	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	
001360	南矿集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	
001367	海森药业	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	
301157	华塑科技	2023年03月01日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	
301203	国泰环保	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	

		日		限						
301260	格力博	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	664	20,484.40	15,690.32	
301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	31.59	25.10	337	10,647.38	8,458.70	
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	
301317	鑫磊股份	2023年01月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	
301345	涛涛车业	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	163	11,972.35	7,602.32	
301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	382	9,080.14	16,383.98	
301373	凌玮科技	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	
301439	泓	2023	6	新	19.99	16.90	475	9,495.25	8,027.50	

	淋电力	年 03 月 10 日	个 月	股 流 通 受 限						
601061	中信金属	2023 年 03 月 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	6.58	7.58	1,453	9,560.74	11,013.74	
601065	江西省盐业集团	2023 年 03 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	10.36	11.84	88	911.68	1,041.92	
601133	柏诚系统股份公司	2023 年 03 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	11.66	12.26	426	4,967.16	5,222.76	
603135	中重科技	2023 年 03 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	17.80	17.89	456	8,116.80	8,157.84	
688433	华曙高科	2023 年 04 月 07 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	26.66	31.50	179	4,772.14	5,638.50	
688484	南芯科技	2023 年 03 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	39.99	36.71	367	14,676.33	13,472.57	

688535	华海诚科新材料	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	
601916	浙商银行	2023年06月27日	7个交易日	配股流通受限	2.02	2.64	243,750	492,375.00	643,500.00	
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	受限期	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
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“科源制药”（证券代码：301281）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的96股（根据山东科源制药股份有限公司2022年年度权益分派实施公告，科源制药以公司现有总股本77,350,000股为基数，向全体股东每10股派4元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每10股转增4股，除权除息日为2023年5月26日。）。

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 2023 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证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 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证券款余额。

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 2023 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。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023	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
-------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----

年 06 月 30 日		月			上		
资产							
银行存款	8,538,323.03	-	-	-	-	-	8,538,323.03
结算备付金	2,421,621.04	-	-	-	-	-	2,421,621.04
存出保证金	9,124.09	-	-	-	-	1,241,049.60	1,250,173.69
交易性金融资产	-	-	-	-	-	444,702,713.95	444,702,713.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	10,969,068.16	-	-	-	-	445,943,763.55	456,912,831.71
负债							

短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	202,429.25	202,429.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	55,251.30	55,251.30
应付托管费	-	-	-	-	-	18,417.10	18,417.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.90	0.90
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	309,277.69	309,277.69

负债							
负债总计	-	-	-	-	-	585,376.24	585,376.24
利率敏感度缺口	10,969,068.16	-	-	-	-	445,358,387.31	456,327,455.47
上年度末2022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	9,476,309.11	-	-	-	-	-	9,476,309.11
结算备付金	2,412,495.26	-	-	-	-	-	2,412,495.26
存出保证金	15,174.11	-	-	-	-	1,398,960.00	1,414,134.11
交易性金融资产	-	-	32,706.45	-	-	435,381,390.27	435,414,096.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购	-	-	-	-	-	-	-

款							
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,903,978.48	-	32,706.45	-	-	436,780,350.27	448,717,035.20
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	57,297.27	57,297.27
应付托管费	-	-	-	-	-	19,099.12	19,099.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问	-	-	-	-	-	-	-

费							
应交税费	-	-	-	-	-	0.59	0.59
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	230,554.54	230,554.54
负债总计	-	-	-	-	-	306,951.52	306,951.52
利率敏感度缺口	11,903,978.48	-	32,706.45	-	-	436,473,398.75	448,410,083.68

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

本基金本报告期末未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

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 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	444,702,713.	97.45	435,381,390.	97.09

	95		27	
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	32,706.45	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	444,702,713.95	97.45	435,414,096.72	97.10

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	<p>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；</p> <p>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。</p>		
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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	中证长三角一体化发展主题指数上涨 5%	22,553,724.56	22,191,512.43
中证长三角一体化发展主题指数下跌 5%	-22,553,724.56	-22,191,512.43	

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日
第一层次	443,818,757.65
第二层次	675,523.04
第三层次	208,433.26
合计	444,702,713.95

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会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将相关投资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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，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	444,702,713.95	97.33
	其中：股票	444,702,713.95	97.33
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	10,959,944.07	2.40
8	其他各项资产	1,250,173.69	0.27
9	合计	456,912,831.71	100.00

注：此处股票投资项含可退替代款估值增值，而“报告期末按行业分类的股票投资组合”章节的合计项不含可退替代款估值增值，最终导致两者在金额上不相等。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	211,945.00	0.05
B	采矿业	1,676,160.00	0.37
C	制造业	233,480,688.27	51.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,137,312.00	0.25
E	建筑业	7,282,156.75	1.60
F	批发和零售业	9,435,378.14	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	7,882,701.98	1.73
H	住宿和餐饮业	1,808,680.00	0.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,730,316.44	9.36
J	金融业	112,087,789.57	24.56
K	房地产业	2,045,163.00	0.45
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,618,899.58	4.52
N	水利、环境和公共设施管理业	1,988,696.40	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	658,793.52	0.14

R	文化、体育和娱乐业	1,417,428.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	444,462,108.65	97.40

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	168,168.09	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	5,222.76	0.00
F	批发和零售业	23,877.98	0.01
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	7,740.00	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	240,456.30	0.05

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	603259	药明康德	300,162	18,703,094.22	4.10
2	300274	阳光电源	127,685	14,891,901.55	3.26
3	601601	中国太保	534,003	13,873,397.94	3.04
4	002142	宁波银行	530,014	13,409,354.20	2.94
5	600919	江苏银行	1,775,547	13,050,270.45	2.86
6	600276	恒瑞医药	250,303	11,989,513.70	2.63
7	002415	海康威视	359,071	11,888,840.81	2.61
8	300059	东方财富	816,810	11,598,702.00	2.54
9	601328	交通银行	1,933,200	11,212,560.00	2.46
10	002050	三花智控	337,856	10,223,522.56	2.24
11	600406	国电南瑞	418,565	9,668,851.50	2.12
12	002304	洋河股份	67,128	8,817,262.80	1.93
13	600570	恒生电子	197,452	8,745,149.08	1.92
14	688599	天合光能	192,589	8,206,217.29	1.80
15	002230	科大讯飞	105,400	7,162,984.00	1.57
16	605117	德业股份	44,460	6,648,993.00	1.46
17	600837	海通证券	664,100	6,123,002.00	1.34
18	601688	华泰证券	407,100	5,605,767.00	1.23
19	603369	今世缘	104,000	5,491,200.00	1.20
20	300033	同花顺	30,787	5,396,345.36	1.18
21	002555	三七互娱	153,400	5,350,592.00	1.17
22	688012	中微半导体设备	31,209	4,882,648.05	1.07

23	600926	杭州银行	400,942	4,711,068.50	1.03
24	600732	爱旭股份	146,040	4,490,730.00	0.98
25	601211	国泰君安	311,700	4,360,683.00	0.96
26	601009	南京银行	516,200	4,129,600.00	0.90
27	600150	中国船舶	120,800	3,975,528.00	0.87
28	601229	上海银行	688,000	3,956,000.00	0.87
29	600845	宝信软件	77,572	3,941,433.32	0.86
30	600196	复星医药	126,600	3,911,940.00	0.86
31	600958	东方证券	402,716	3,906,345.20	0.86
32	601689	拓普集团	46,400	3,744,480.00	0.82
33	603799	华友钴业	81,070	3,721,923.70	0.82
34	300450	先导智能	102,060	3,691,510.20	0.81
35	002252	上海莱士	483,100	3,628,081.00	0.80
36	000963	华东医药	83,452	3,619,313.24	0.79
37	603501	韦尔股份	36,854	3,613,166.16	0.79
38	601100	恒立液压	55,245	3,553,910.85	0.78
39	000596	古井贡酒	13,700	3,389,106.00	0.74
40	002384	东山精密	128,400	3,325,560.00	0.73
41	600000	浦发银行	451,983	3,272,356.92	0.72
42	600104	上汽集团	226,001	3,202,434.17	0.70
43	603659	璞泰来	83,360	3,186,019.20	0.70
44	600009	上海机场	68,219	3,098,506.98	0.68

45	601877	正泰电 器	110,000	3,041,500.00	0.67
46	601916	浙商银 行	1,086,950	2,869,548.00	0.63
47	002463	沪电股 份	130,690	2,736,648.60	0.60
48	688008	澜起科 技	47,605	2,733,479.10	0.60
49	600585	海螺水 泥	114,500	2,718,230.00	0.60
50	603605	珀莱雅	24,180	2,717,832.00	0.60
51	601825	沪农商 行	483,100	2,632,895.00	0.58
52	002493	荣盛石 化	219,750	2,557,890.00	0.56
53	600522	中天科 技	160,400	2,551,964.00	0.56
54	002236	大华股 份	120,997	2,389,690.75	0.52
55	000425	徐工机 械	352,900	2,389,133.00	0.52
56	603899	晨光股 份	49,700	2,218,608.00	0.49
57	600019	宝钢股 份	386,900	2,174,378.00	0.48
58	601607	上海医 药	96,600	2,164,806.00	0.47
59	002001	新和 成	138,400	2,131,360.00	0.47
60	600487	亨通光 电	144,900	2,124,234.00	0.47
61	688777	中控技 术	33,399	2,096,789.22	0.46
62	688126	上海硅 产业集 团	99,708	2,083,897.20	0.46
63	600741	华域汽 车	112,800	2,082,288.00	0.46
64	600584	长电科 技	65,200	2,032,284.00	0.45
65	600521	华海药 业	108,730	2,001,719.30	0.44
66	601788	光大证 券	124,600	1,979,894.00	0.43

67	600862	中航高科	76,000	1,923,560.00	0.42
68	300347	泰格医药	29,684	1,915,805.36	0.42
69	600176	中国巨石	134,487	1,904,335.92	0.42
70	603338	浙江鼎力	32,600	1,825,926.00	0.40
71	002472	双环传动	49,700	1,804,110.00	0.40
72	300782	卓胜微	18,209	1,759,535.67	0.39
73	600985	淮北矿业	145,500	1,676,160.00	0.37
74	000739	普洛药业	88,100	1,562,894.00	0.34
75	600460	士兰微	51,500	1,558,905.00	0.34
76	603486	科沃斯	19,531	1,518,925.87	0.33
77	300999	金龙鱼	37,900	1,515,621.00	0.33
78	002508	老板电器	59,922	1,515,427.38	0.33
79	600398	海澜之家	216,700	1,490,896.00	0.33
80	600170	上海建工	553,200	1,488,108.00	0.33
81	002444	巨星科技	67,900	1,485,652.00	0.33
82	603195	公牛集团	15,332	1,472,791.92	0.32
83	600160	巨化股份	106,600	1,468,948.00	0.32
84	002409	雅克科技	20,000	1,457,600.00	0.32
85	603129	春风动力	8,900	1,440,910.00	0.32
86	000630	铜陵有色	498,300	1,440,087.00	0.32
87	600820	隧道股份	238,300	1,432,183.00	0.31
88	603806	福斯特	38,070	1,415,823.30	0.31
89	600970	中材国际	110,400	1,407,600.00	0.31
90	600754	锦江酒店	33,000	1,397,220.00	0.31

91	603290	斯达半导	6,300	1,355,760.00	0.30
92	603456	九洲药业	49,400	1,352,572.00	0.30
93	600352	浙江龙盛	142,400	1,331,440.00	0.29
94	002430	杭氧股份	38,000	1,305,680.00	0.29
95	601865	福莱特	33,800	1,301,638.00	0.29
96	603179	新泉股份	29,600	1,299,144.00	0.28
97	603816	顾家家居	33,740	1,287,181.00	0.28
98	600486	扬农化工	14,400	1,258,848.00	0.28
99	601872	招商轮船	214,700	1,243,113.00	0.27
100	603185	弘元绿能	16,400	1,222,620.00	0.27
101	688099	晶晨半导体	14,476	1,220,616.32	0.27
102	601799	星宇股份	9,626	1,189,773.60	0.26
103	002085	万丰奥威	169,100	1,171,863.00	0.26
104	002648	卫星化学	78,325	1,171,742.00	0.26
105	000738	航发控制	47,700	1,163,880.00	0.26
106	002244	滨江集团	131,400	1,158,948.00	0.25
107	603260	合盛硅业	16,400	1,148,328.00	0.25
108	600021	上海电力	105,600	1,137,312.00	0.25
109	002624	完美世界	66,300	1,119,807.00	0.25
110	002080	中材科技	51,407	1,054,871.64	0.23
111	300017	网宿科技	141,500	1,006,065.00	0.22
112	600018	上港集团	180,000	945,000.00	0.21

113	603568	伟明环保	53,840	942,738.40	0.21
114	600612	老凤祥	13,000	908,440.00	0.20
115	601155	新城控股	61,500	886,215.00	0.19
116	002541	鸿路钢构	29,060	837,218.60	0.18
117	600704	物产中大	168,300	831,402.00	0.18
118	300373	扬杰科技	19,400	787,058.00	0.17
119	002266	浙富控股	189,400	782,222.00	0.17
120	002120	韵达股份	81,400	778,184.00	0.17
121	300088	长信科技	128,700	776,061.00	0.17
122	300682	朗新科技	33,200	772,896.00	0.17
123	600884	杉杉股份	50,900	770,626.00	0.17
124	600655	豫园股份	108,665	745,441.90	0.16
125	600315	上海家化	25,600	742,656.00	0.16
126	601231	环旭电子	47,800	715,088.00	0.16
127	600177	雅戈尔	112,100	707,351.00	0.16
128	000887	中鼎股份	53,000	693,770.00	0.15
129	002064	华峰化学	97,100	666,106.00	0.15
130	600596	新安股份	60,500	661,265.00	0.14
131	002032	苏泊尔	13,200	660,000.00	0.14
132	300244	迪安诊断	25,704	658,793.52	0.14
133	688006	浙江杭可科技	20,800	633,776.00	0.14
134	601928	凤凰传媒	54,500	621,300.00	0.14
135	300226	上海钢	18,830	610,092.00	0.13

		联			
136	600827	百联股份	44,100	589,617.00	0.13
137	600850	电科数字	24,700	582,673.00	0.13
138	600606	绿地控股	202,281	556,272.75	0.12
139	002761	浙江建投	34,300	520,674.00	0.11
140	601611	中国核建	61,500	519,675.00	0.11
141	603236	移远通信	8,374	483,263.54	0.11
142	000559	万向钱潮	88,500	482,325.00	0.11
143	600502	安徽建工	86,700	457,776.00	0.10
144	601866	中远海发	183,400	452,998.00	0.10
145	300170	汉得信息	39,200	452,368.00	0.10
146	600210	紫江企业	85,000	452,200.00	0.10
147	601018	宁波港	131,600	446,124.00	0.10
148	601156	东航物流	34,200	444,600.00	0.10
149	300171	东富龙	19,200	436,800.00	0.10
150	000156	华数传媒	49,200	428,040.00	0.09
151	600987	航民股份	49,800	409,854.00	0.09
152	600710	苏美达	47,700	408,312.00	0.09
153	002091	江苏国泰	52,200	393,588.00	0.09
154	601801	皖新传媒	39,200	368,088.00	0.08
155	002061	浙江交科	77,600	346,096.00	0.08
156	600500	中化国际	61,400	341,384.00	0.07
157	000727	冠捷科技	158,800	336,656.00	0.07
158	002563	森马服	51,900	322,818.00	0.07

		饰			
159	603071	物产环能	19,400	321,846.00	0.07
160	002081	金螳螂	66,800	301,268.00	0.07
161	002043	兔宝宝	26,100	284,751.00	0.06
162	600662	外服控股	49,600	283,712.00	0.06
163	600073	上海梅林	38,800	283,240.00	0.06
164	000930	中粮科技	34,800	281,880.00	0.06
165	600475	华光环能	22,200	263,736.00	0.06
166	603355	莱克电气	10,300	261,723.00	0.06
167	688298	东方基因生物	6,872	259,211.84	0.06
168	605108	同庆楼	7,600	253,840.00	0.06
169	600491	龙元建设	50,100	252,504.00	0.06
170	002556	辉隆股份	32,400	235,224.00	0.05
171	301216	万凯新材	13,300	221,179.00	0.05
172	300761	立华股份	11,500	211,945.00	0.05
173	301090	华润材料	15,500	195,610.00	0.04
174	600575	淮河能源	74,400	190,464.00	0.04
175	601388	怡球资源	63,300	182,304.00	0.04
176	601007	金陵饭店	18,500	157,620.00	0.03
177	002645	华宏科技	11,900	145,894.00	0.03
178	600278	东方创业	16,600	125,828.00	0.03
179	601339	百隆东方	20,600	115,360.00	0.03
180	600370	三房巷	32,800	87,904.00	0.02

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	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
2	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
3	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
4	301358	湖南裕能	382	16,383.98	0.00
5	301260	格力博	664	15,690.32	0.00
6	688484	南芯科技	367	13,472.57	0.00
7	001287	中电港	612	12,864.24	0.00
8	601061	中信金属	1,453	11,013.74	0.00
9	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
10	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
11	688535	华海诚科 新材料	161	8,248.03	0.00
12	603135	中重科技	456	8,157.84	0.00
13	301439	泓淋电力	475	8,027.50	0.00
14	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
15	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
16	301345	涛涛车业	163	7,602.32	0.00
17	688433	华曙高科	179	5,638.50	0.00
18	601133	柏诚系统 股份公司	426	5,222.76	0.00
19	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
20	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
21	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
22	601065	江西省盐 业集团	88	1,041.92	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	300274	阳光电源	6,138,510.00	1.37
2	601601	中国太保	5,927,033.00	1.32

3	605117	德业股份	5,427,936.68	1.21
4	600732	爱旭股份	3,895,235.00	0.87
5	600150	中国船舶	3,279,001.00	0.73
6	601916	浙商银行	2,899,197.00	0.65
7	600919	江苏银行	2,866,296.00	0.64
8	601825	沪农商行	2,831,475.00	0.63
9	002050	三花智控	2,793,730.00	0.62
10	600837	海通证券	2,511,557.00	0.56
11	600570	恒生电子	2,471,816.00	0.55
12	688599	天合光能	2,440,186.86	0.54
13	601688	华泰证券	2,301,197.00	0.51
14	002142	宁波银行	2,184,502.00	0.49
15	688126	上海硅产业集团	2,051,646.36	0.46
16	601788	光大证券	1,963,750.00	0.44
17	601211	国泰君安	1,627,545.00	0.36
18	600958	东方证券	1,541,593.00	0.34
19	002409	雅克科技	1,340,900.00	0.30
20	603259	药明康德	1,328,302.00	0.30

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	000425	徐工机械	3,025,792.00	0.67
2	002415	海康威视	2,632,902.00	0.59
3	300059	东方财富	2,380,860.60	0.53
4	002602	世纪华通	2,271,093.85	0.51
5	002230	科大讯飞	2,184,717.00	0.49
6	600018	上港集团	2,014,797.00	0.45
7	600276	恒瑞医药	1,999,362.80	0.45
8	603659	璞泰来	1,846,338.02	0.41
9	002463	沪电股份	1,840,140.00	0.41
10	688008	澜起科技	1,818,162.91	0.41
11	600741	华域汽车	1,729,115.00	0.39
12	000301	东方盛虹	1,650,816.41	0.37
13	600406	国电南瑞	1,514,157.00	0.34
14	600845	宝信软件	1,481,730.00	0.33
15	600584	长电科技	1,480,525.00	0.33
16	600160	巨化股份	1,448,445.00	0.32

17	605358	立昂微	1,429,126.00	0.32
18	600522	中天科技	1,408,192.00	0.31
19	601328	交通银行	1,357,845.00	0.30
20	603816	顾家家居	1,347,841.00	0.30

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	95,064,425.01
卖出股票收入（成交）总额	91,045,080.50

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 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：本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，宁波银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、交通银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	1,250,173.69
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,250,173.69

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	001286	陕西能源	35,447.47	0.01	新股流通受限
2	301301	川宁生物	32,023.04	0.01	新股流通受限
3	301317	鑫磊股份	18,161.98	0.00	新股流通受限
4	301358	湖南裕能	16,383.98	0.00	新股流通受限

5	301260	格力博	15,690.32	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 (%)
412	1,123,644.73	414,071,127.00	89.44	48,870,500.00	10.56	48,915,000.00	10.57

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“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	宁波开发投资集团有限公司	352,354,426.00	76.11
2	汤奇青	45,865,000.00	9.91
3	招商证券股份有限公司	4,802,800.00	1.04
4	广发证券股份有限公司	2,694,500.00	0.58
5	方正证券股份有限公司	1,631,800.00	0.35
6	中国平安财产保险股份有限公司-传统-普通保	1,463,400.00	0.32

	险产品		
7	中信证券股份有限公司	1,443,521.00	0.31
8	华泰证券股份有限公司	764,680.00	0.17
9	王棟	290,000.00	0.06
10	王安	200,000.00	0.04
11	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	48,915,000.00	10.57

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、基金投资和相关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	466,941,627.00
本报告期基金总申购份额	10,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	14,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	462,941,627.00

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，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

报告期内，不涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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	

			(%)		(%)	
浙商证券	1	103,983,412.23	56.95	75,000.36	58.53	
东方证券	3	65,077,611.14	35.64	46,941.48	36.63	
长江证券	1	8,907,265.60	4.88	2,861.96	2.23	
申万宏源证券	3	3,033,503.77	1.66	2,188.03	1.71	
东北证券	2	1,592,934.15	0.87	1,149.06	0.90	
中信建投证券	1	-	-	-	-	
中信证券	3	-	-	-	-	

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 (%)
浙商证券	556,389.88	83.92	-	-	-	-	-	-
东方证券	106,645.06	16.08	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信	-	-	-	-	-	-	-	-

建投 证券								
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旗下基金2022年第四季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023年01月20日
2	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023年03月13日

3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	352,354,426.00	-	-	352,354,426.00	76.11

产品持有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

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

2、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。

3、提前终止基金合同的风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准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规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

上海市黄浦区外马路728号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2023年08月31日