

中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券 投资基金更新招募说明书摘要 (2020年4月14日更新)

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

重要提示

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；证券简称：长三角；扩位证券简称：长三角ETF；证券代码：512650；申购赎回代码：512651；以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2019】779号文注册，进行募集。本基金基金合同于2019年7月26日正式生效。

基金管理人保证《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招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是交易型开放式指数证券投资基金，特定风险还包括：标的指数的风险，基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金交

易价格与份额净值发生偏离的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退补现金替代方式的风险、赎回对价的变现风险等等。

本基金更新招募说明书“基金的投资”章节中有关“风险收益特征”的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行“销售适当性风险评价”，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的基金产品“风险等级评价”与“基金的投资”章节中“风险收益特征”的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

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。

投资者申购的基金份额当日起可卖出，投资者赎回获得的股票当日起可卖出。

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金本次更新的招募说明书主要根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和修订后的基金合同对相关信息进行更新，同时对基金管理人、基金托管人、财务数据和净值表现等其他信息一并更新，更新所载内容截止日为 2020 年 4 月 14 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 12 月 31 日。

一、基金管理人

一、基金管理人简况

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室

办公地址：上海市富城路99号震旦国际大楼20楼

法定代表人：李文

成立时间：2005年2月3日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2005]5号

注册资本：人民币132,724,224元

联系人：李鹏

联系电话：021-28932888

股东名称及其出资比例：

股东名称	股权比例
东方证券股份有限公司	35.412%
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	24.656%
上海上报资产管理有限公司	19.966%
东航金控有限责任公司	19.966%
合计	100%

二、主要人员情况

1、董事会成员

李文先生，2015年4月16日担任董事长。国籍：中国，厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长，汇添富资产管理(香港)有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处科长，中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局杏林支局副局长、副局长，中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处长，东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理，稽核总部总经理，东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理，汇添富基金管理股份有限公司督察长。

程峰先生，2016年11月20日担任董事。国籍：中国，上海交通大学工商管理硕士。现任上海报业集团副总经理，上海上报资产管理有限公司董事长，上海

文化产权交易所股份有限公司董事长，上海瑞力投资基金管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会团委副书记、书记，上海机械进出口(集团)有限公司副总裁，上海市对外经济贸易委员会技术进口处副处长，上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长、处长，上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任，上海国际集团有限公司行政管理总部总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长，上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。

林福杰先生，2018年3月21日担任董事。国籍：中国，上海交通大学工商管理硕士。现任东航金控有限责任公司总经理、党委副书记、东航集团财务有限责任公司董事长。曾任东航期货有限责任公司部门经理，东航集团财务有限责任公司副总经理，国泰人寿保险有限责任公司副总经理，东航金控有限责任公司党委书记、副总经理。

张晖先生，2015年4月16日担任董事，总经理。国籍：中国，上海财经大学经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理，汇添富资本管理有限公司董事长。历任申银万国证券研究所高级分析师，富国基金管理有限公司研究主管和基金经理，汇添富基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监，曾担任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

林志军先生，2015年4月16日担任独立董事。国籍：中国香港，厦门大学经济学博士，加拿大Saskatchewan大学工商管理理学硕士。现任澳门科技大学副校长兼商学院院长、教授、博导。历任福建省科学技术委员会计划财务处会计，五大国际会计师事务所 Touche Ross International(现为德勤)加拿大多伦多分所审计员，厦门大学会计师事务所副主任会计师，厦门大学经济学院讲师、副教授，伊利诺大学(University of Illinois)国际会计教育与研究中心访问学者，美国斯坦福大学(Stanford University)经济系访问学者，加拿大Lethbridge大学管理学院会计学讲师、副教授(tenured)，香港大学商学院访问教授，香港浸会大学商学院会计与法律系教授，博导，系主任。

杨燕青女士，2011年12月19日担任独立董事，国籍：中国，复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑，第一财经研究院院长，国家金融与发展实验室特邀高级研究员，上海政协委员，《第一财经日报》创始编委之一，第

一财经频道高端对话节目《经济学人》等栏目创始人和主持人，《波士堂》等栏目资深评论员。2002-2003年期间受邀成为约翰-霍普金斯大学访问学者。

魏尚进 (Shangjin Wei) 先生, 2020年1月9日担任独立董事, 国籍: 美国, 加州大学伯克利分校博士。现任复旦大学泛海国际金融学院访问教授、哥伦比亚大学终身讲席教授。曾任哈佛大学肯尼迪政府学院助理教授、副教授, 世界银行顾问, 国际货币基金组织工作贸易与投资处处长、研究局助理局长。

2、监事会成员

任瑞良先生, 2004年10月20日担任监事, 2015年6月30日担任监事会主席。国籍: 中国, 大学学历, 会计师、非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上报资产管理有限公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管, 文汇新民联合报业集团文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理等。

王如富先生, 2015年9月8日担任监事。国籍: 中国, 硕士研究生, 注册会计师。现任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任。历任申银万国证券计划统筹总部综合计划部专员、发展协调办公室专员, 金信证券规划发展总部总经理助理、秘书处副主任(主持工作), 东方证券研究所证券市场战略资深研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

毛海东先生, 2015年6月30日担任监事, 国籍: 中国, 国际金融学硕士。现任东航金控有限责任公司总经理助理兼财富管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责任公司, 东航集团财务有限责任公司。

王静女士, 2008年2月23日担任职工监事, 国籍: 中国, 中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部, 东航金控有限责任公司研究发展部。

林旋女士, 2008年2月23日担任职工监事, 国籍: 中国, 华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监, 汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生, 2013年8月8日担任职工监事, 国籍: 中国, 北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司, 泰科电子(上海)有限公司能源事业部。

3、高管人员

李文先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

张晖先生，2015年6月25日担任总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

雷继明先生，2012年3月7日担任副总经理。国籍：中国，工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理，中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011年12月加盟汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

娄焱女士，2013年1月7日担任副总经理。国籍：中国，金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处工作，负责投资银行、证券投资研究，以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

袁建军先生，2015年8月5日担任副总经理。国籍：中国，金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理，汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理，并于2014年至2015年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。

李骁先生，2017年3月3日担任副总经理。国籍：中国，武汉大学金融学硕士。历任厦门建行计算机处副处长，厦门建行信用卡部副处长、处长，厦门建行信息技术部处长，建总行北京开发中心负责人，建总行信息技术管理部副总经理，建总行信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任，建总行信息技术管理部资深专员（副总经理级）。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席技术官。

李鹏先生，2015年6月25日担任督察长。国籍：中国，上海财经大学经济学博士，历任上海证监局主任科员、副处长，上海农商银行同业金融部副总经理，汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

4、基金经理

吴振翔先生，国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士，14年证券从业经验。曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限

公司产品开发高级经理。2008年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011年9月16日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金的基金经理，2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理，2013年8月23日至2015年11月2日任中证主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金的基金经理，2013年11月6日至今任汇添富沪深300安中指数基金的基金经理，2015年2月16日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理，2015年3月24日至今任汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理，2016年1月21日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理，2016年7月28日至今任中证上海国企ETF的基金经理，2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数（LOF）的基金经理，2017年8月10日至今任汇添富中证500指数（LOF）的基金经理，2018年3月23日至今任添富价值多因子股票的基金经理，2019年7月26日至今任添富中证长三角ETF的基金经理，2019年9月24日至今任汇添富中证长三角ETF联接的基金经理，2019年11月6日任添富中证国企一带一路ETF的基金经理，2020年3月5日任添富中证国企一带一路ETF联接基金的基金经理。

乐无穹女士，国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士，6年证券从业经验。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日至今任添富中证银行ETF联接的基金经理，2019年7月26日至今任添富中证长三角ETF的基金经理，2019年10月8日至今任添富中证800ETF的基金经理。

5、投资决策委员会

主席：袁建军（副总经理）

成员：韩贤旺（首席经济学家）、王栩（总经理助理，权益投资总监）、陆文磊（总经理助理，固定收益投资总监）、劳杰男（研究总监）

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

成立时间：1992 年 10 月 19 日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：胡波

联系电话：(021) 61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年更名为资产托管与养老金业务部，2016 年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基

金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

三、相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、申购赎回代理券商

本基金的申购赎回代理券商请详见基金管理人官网公示的销售机构信息表。基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并在基金管理人网站公示。

2、二级市场交易代理券商

本基金办理二级市场交易业务的销售机构为具有基金销售业务资格、经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位。具体会员单位名单可在上海证券交易所网站查询。

二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：010-58598839

传真：010-58598907

联系人：朱立元

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：(021) 31358666

传真：（021）31358600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

邮政编码：100738

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

业务联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、许培菁

四、基金的名称

本基金名称：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

证券简称：长三角

扩位证券简称：长三角ETF

证券代码（二级市场交易代码）：512650

申购赎回代码：512651

五、基金的类型

本基金为股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。

为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、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。

八、基金的投资策略

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。

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

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。

1、资产配置策略

本基金管理人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。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

2、债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。

3、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策。

4、金融衍生工具投资策略

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货、股票期权等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

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。

本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，以套期保值为目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

5、融资及转融通投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明更新中公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数收益率，即中证长三角一体化发展主题指数收益率。

中证长三角一体化发展主题指数由中证指数有限公司发布。如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或上述标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致上述指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变

更、指数更名等事项)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 03 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。

本报告期自 2019 年 07 月 26 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

§ 1 投资组合报告

1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,637,411,323.52	96.56
	其中：股票	4,637,411,323.52	96.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	331,000.00	0.01
	其中：债券	331,000.00	0.01
	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	141,650,773.87	2.95
8	其他各项资产	23,353,983.55	0.49
9	合计	4,802,747,080.94	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 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	5,304,420.00	0.11
B	采矿业	2,599,398.00	0.05
C	制造业	1,853,760,081.16	38.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	282,087,829.00	5.91
E	建筑业	45,760,015.00	0.96
F	批发和零售业	112,968,146.00	2.37
G	交通运输、仓储和邮政业	200,273,787.50	4.19
H	住宿和餐饮业	4,731,408.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	250,534,891.80	5.25
J	金融业	1,250,699,688.12	26.18
K	房地产业	150,567,156.60	3.15
L	租赁和商务服务业	27,715,541.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	53,827,834.76	1.13
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	14,166,324.00	0.30
Q	卫生和社会工作	111,568,103.00	2.34
R	文化、体育和娱乐业	35,450,972.00	0.74
S	综合	-	-
	合计	4,402,015,595.94	92.16

1.2.2 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	233,093,110.56	4.88
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	-	-
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	2,296,038.98	0.05
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	6,578.04	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	235,395,727.58	4.93

1.2.3 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股票投资。

1.3 期末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

1.3.1 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	600623	华谊集团	42,106,300	280,006,895.00	5.86
2	600023	浙能电力	66,006,500	261,385,740.00	5.47
3	600585	海螺水泥	4,637,250	254,121,300.00	5.32

4	601601	中国太保	6,405,146	242,370,724.64	5.07
5	600276	恒瑞医药	2,667,505	233,460,037.60	4.89
6	600000	浦发银行	14,175,756	175,354,101.72	3.67
7	002415	海康威视	3,420,150	111,975,711.00	2.34
8	601328	交通银行	17,802,200	100,226,386.00	2.10
9	600837	海通证券	5,986,200	92,546,652.00	1.94
10	002142	宁波银行	3,061,360	86,177,284.00	1.80
11	600009	上海机场	953,134	75,059,302.50	1.57
12	600919	江苏银行	10,066,159	72,878,991.16	1.53
13	601229	上海银行	7,208,200	68,405,818.00	1.43
14	601009	南京银行	7,559,400	66,295,938.00	1.39
15	002463	沪电股份	2,855,100	63,411,771.00	1.33
16	601688	华泰证券	2,872,400	58,338,444.00	1.22
17	600486	扬农化工	789,700	54,197,111.00	1.13
18	603259	药明康德	584,323	53,827,834.76	1.13
19	300059	东方财富	3,315,000	52,277,550.00	1.09
20	600570	恒生电子	661,860	51,446,377.80	1.08
21	601155	新城控股	1,261,200	48,833,664.00	1.02
22	002304	洋河股份	397,028	43,871,594.00	0.92
23	600104	上汽集团	1,772,800	42,281,280.00	0.89
24	002044	美年健康	2,822,760	42,030,896.40	0.88
25	002024	苏宁易购	3,816,000	38,579,760.00	0.81
26	300347	泰格医药	576,984	36,436,539.60	0.76
27	601211	国泰君安	1,949,600	36,048,104.00	0.75
28	600406	国电南瑞	1,653,200	35,014,776.00	0.73
29	002230	科大讯飞	988,000	34,066,240.00	0.71
30	000961	中南建设	3,044,800	32,122,640.00	0.67
31	600741	华域汽车	1,226,000	31,863,740.00	0.67
32	002555	三七互娱	1,160,100	31,241,493.00	0.65
33	002236	大华股份	1,567,300	31,157,924.00	0.65
34	000425	徐工机械	5,556,200	30,392,414.00	0.64
35	601877	正泰电器	1,049,500	28,126,600.00	0.59
36	600763	通策医疗	270,800	27,765,124.00	0.58
37	002001	新和成	1,184,000	27,539,840.00	0.58
38	600177	雅戈尔	3,947,000	27,510,590.00	0.58
39	600352	浙江龙盛	1,861,300	26,933,011.00	0.56
40	300144	宋城演艺	867,000	26,798,970.00	0.56
41	600018	上港集团	4,339,800	25,040,646.00	0.52
42	600019	宝钢股份	4,277,600	24,553,424.00	0.51
43	002384	东山精密	1,050,100	24,309,815.00	0.51
44	002602	世纪华通	2,041,994	23,339,991.42	0.49

45	600958	东方证券	2,107,300	22,674,548.00	0.47
46	300033	同花顺	206,300	22,509,393.00	0.47
47	601128	常熟银行	2,427,900	22,118,169.00	0.46
48	600061	国投资本	1,349,600	20,432,944.00	0.43
49	600606	绿地控股	2,884,300	20,045,885.00	0.42
50	000963	华东医药	813,300	19,828,254.00	0.42
51	600170	上海建工	5,555,900	19,667,886.00	0.41
52	002127	南极电商	1,755,500	19,152,505.00	0.40
53	002120	韵达股份	565,700	18,837,810.00	0.39
54	002508	老板电器	547,300	18,504,213.00	0.39
55	600196	复星医药	691,500	18,393,900.00	0.39
56	002050	三花智控	1,056,500	18,309,145.00	0.38
57	000596	古井贡酒	127,200	17,289,024.00	0.36
58	601108	财通证券	1,519,100	17,226,594.00	0.36
59	600926	杭州银行	1,840,800	16,861,728.00	0.35
60	002493	荣盛石化	1,350,400	16,731,456.00	0.35
61	601788	光大证券	1,273,700	16,685,470.00	0.35
62	603799	华友钴业	396,600	15,622,074.00	0.33
63	601990	南京证券	1,172,760	15,140,331.60	0.32
64	601021	春秋航空	330,400	14,501,256.00	0.30
65	600176	中国巨石	1,328,700	14,482,830.00	0.30
66	300088	长信科技	1,391,800	14,293,786.00	0.30
67	600208	新潮中宝	3,778,200	14,281,596.00	0.30
68	002607	中公教育	792,300	14,166,324.00	0.30
69	002624	完美世界	318,400	14,054,176.00	0.29
70	600115	东方航空	2,408,700	13,994,547.00	0.29
71	601799	星宇股份	138,800	13,183,224.00	0.28
72	600273	嘉化能源	1,171,600	13,180,500.00	0.28
73	002019	亿帆医药	810,300	13,167,375.00	0.28
74	600643	爱建集团	1,329,800	12,766,080.00	0.27
75	300782	卓胜微	30,401	12,475,658.37	0.26
76	300253	卫宁健康	816,500	12,231,170.00	0.26
77	600584	长电科技	538,600	11,838,428.00	0.25
78	002081	金螳螂	1,339,100	11,810,862.00	0.25
79	300357	我武生物	267,200	11,796,880.00	0.25
80	000728	国元证券	1,259,200	11,672,784.00	0.24
81	601607	上海医药	630,300	11,578,611.00	0.24
82	600487	亨通光电	702,200	11,417,772.00	0.24
83	600704	物产中大	2,124,400	11,153,100.00	0.23
84	603501	韦尔股份	76,900	11,027,460.00	0.23
85	600909	华安证券	1,480,600	10,808,380.00	0.23

86	601555	东吴证券	1,040,900	10,398,591.00	0.22
87	300017	网宿科技	1,087,800	10,366,734.00	0.22
88	002032	苏泊尔	134,700	10,342,266.00	0.22
89	600522	中天科技	1,213,800	10,074,540.00	0.21
90	600642	申能股份	1,723,300	10,012,373.00	0.21
91	600820	隧道股份	1,645,900	9,941,236.00	0.21
92	600637	东方明珠	1,049,600	9,824,256.00	0.21
93	601231	环旭电子	509,900	9,805,377.00	0.21
94	002221	东华能源	1,261,400	9,788,464.00	0.20
95	300558	贝达药业	145,100	9,533,070.00	0.20
96	601872	招商轮船	1,131,900	9,349,494.00	0.20
97	600895	张江高科	603,700	9,242,647.00	0.19
98	002223	鱼跃医疗	452,500	9,194,800.00	0.19
99	600663	陆家嘴	643,460	8,693,144.60	0.18
100	601233	桐昆股份	578,443	8,670,860.57	0.18
101	002048	宁波华翔	560,200	8,660,692.00	0.18
102	000630	铜陵有色	3,650,000	8,504,500.00	0.18
103	601727	上海电气	1,700,000	8,466,000.00	0.18
104	601018	宁波港	2,225,700	8,457,660.00	0.18
105	600521	华海药业	480,200	8,288,252.00	0.17
106	603816	顾家家居	181,000	8,277,130.00	0.17
107	601878	浙商证券	736,500	8,197,245.00	0.17
108	600845	宝信软件	238,600	7,849,940.00	0.16
109	603659	璞泰来	88,800	7,561,320.00	0.16
110	600699	均胜电子	418,600	7,492,940.00	0.16
111	601975	招商南油	2,656,700	7,465,327.00	0.16
112	002563	森马服饰	751,600	7,418,292.00	0.16
113	600848	上海临港	300,400	7,374,820.00	0.15
114	300009	安科生物	485,200	7,321,668.00	0.15
115	600377	宁沪高速	646,600	7,254,852.00	0.15
116	600655	豫园股份	918,600	7,201,824.00	0.15
117	600021	上海电力	890,600	7,169,330.00	0.15
118	600901	江苏租赁	1,112,400	7,030,368.00	0.15
119	002387	维信诺	434,400	6,906,960.00	0.14
120	600398	海澜之家	883,900	6,788,352.00	0.14
121	002195	二三四五	2,088,000	6,744,240.00	0.14
122	600572	康恩贝	1,058,900	6,512,235.00	0.14
123	000581	威孚高科	332,500	6,334,125.00	0.13
124	600816	安信信托	1,425,800	6,330,552.00	0.13
125	600150	中国船舶	290,100	6,312,576.00	0.13
126	600160	巨化股份	862,100	6,276,088.00	0.13

127	600026	中远海能	974,600	6,217,948.00	0.13
128	600315	上海家化	200,800	6,212,752.00	0.13
129	002010	传化智联	860,600	6,006,988.00	0.13
130	600460	士兰微	386,000	5,971,420.00	0.13
131	300618	寒锐钴业	71,780	5,913,954.20	0.12
132	002252	上海莱士	791,200	5,870,704.00	0.12
133	002085	万丰奥威	825,400	5,777,800.00	0.12
134	603707	健友股份	134,500	5,579,060.00	0.12
135	300168	万达信息	359,100	5,540,913.00	0.12
136	300244	迪安诊断	241,100	5,335,543.00	0.11
137	300761	立华股份	89,300	5,304,420.00	0.11
138	600776	东方通信	244,800	5,099,184.00	0.11
139	600612	老凤祥	102,600	4,884,786.00	0.10
140	601866	中远海发	1,859,900	4,817,141.00	0.10
141	600754	锦江股份	164,800	4,731,408.00	0.10
142	600850	华东电脑	179,800	4,559,728.00	0.10
143	600667	太极实业	561,300	4,552,143.00	0.10
144	000559	万向钱潮	842,600	4,524,762.00	0.09
145	601611	中国核建	608,700	4,340,031.00	0.09
146	600597	光明乳业	340,900	4,326,021.00	0.09
147	600808	马钢股份	1,390,500	4,268,835.00	0.09
148	600688	上海石化	1,094,300	4,234,941.00	0.09
149	603885	吉祥航空	280,500	4,207,500.00	0.09
150	600827	百联股份	433,600	3,893,728.00	0.08
151	002244	滨江集团	789,900	3,886,308.00	0.08
152	000681	视觉中国	220,500	3,801,420.00	0.08
153	600648	外高桥	218,100	3,788,397.00	0.08
154	002468	申通快递	188,000	3,666,000.00	0.08
155	002608	江苏国信	456,600	3,520,386.00	0.07
156	603515	欧普照明	122,000	3,429,420.00	0.07
157	600823	世茂股份	760,500	3,422,250.00	0.07
158	601928	凤凰传媒	447,000	3,401,670.00	0.07
159	000887	中鼎股份	370,600	3,353,930.00	0.07
160	000301	东方盛虹	644,900	3,340,582.00	0.07
161	002091	江苏国泰	473,400	3,252,258.00	0.07
162	002042	华孚时尚	399,800	2,934,532.00	0.06
163	600604	市北高新	300,700	2,664,202.00	0.06
164	600420	现代制药	291,300	2,604,222.00	0.05
165	600985	淮北矿业	260,200	2,599,398.00	0.05
166	300170	汉得信息	267,900	2,595,951.00	0.05
167	601828	美凯龙	225,600	2,556,048.00	0.05

168	002625	光启技术	259,500	2,374,425.00	0.05
169	603260	合盛硅业	78,300	2,307,501.00	0.05
170	600710	苏美达	409,800	2,274,390.00	0.05
171	603379	三美股份	57,700	2,155,095.00	0.05
172	603486	科沃斯	94,000	1,907,260.00	0.04
173	300768	迪普科技	47,300	1,725,031.00	0.04
174	600981	汇鸿集团	438,000	1,629,360.00	0.03
175	601801	皖新传媒	264,400	1,448,912.00	0.03
176	601860	紫金银行	255,500	1,435,910.00	0.03
177	603056	德邦股份	126,400	1,404,304.00	0.03
178	603256	宏和科技	89,400	1,320,438.00	0.03
179	603868	飞科电器	34,700	1,307,496.00	0.03
180	300766	每日互动	23,300	764,473.00	0.02

1.3.2 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	600126	杭钢股份	47,613,940	232,832,166.60	4.87
2	601916	浙商银行	294,195	1,370,948.70	0.03
3	601077	渝农商行	147,778	925,090.28	0.02
4	688399	硕世生物	2,290	124,827.90	0.00
5	002970	锐明技术	787	96,478.33	0.00
6	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
7	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
8	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	352,773,600.81	7.39
2	601601	中国太保	314,423,548.82	6.58
3	600585	海螺水泥	270,727,325.24	5.67
4	600000	浦发银行	270,182,115.79	5.66
5	601328	交通银行	205,386,925.31	4.30
6	002415	海康威视	179,372,738.46	3.76
7	002304	洋河股份	177,611,333.35	3.72
8	600009	上海机场	138,014,347.27	2.89
9	002142	宁波银行	137,898,806.46	2.89

10	601009	南京银行	98,633,872.70	2.06
11	002463	沪电股份	95,542,376.45	2.00
12	600919	江苏银行	95,518,920.76	2.00
13	600570	恒生电子	89,410,670.38	1.87
14	601211	国泰君安	85,689,211.90	1.79
15	300347	泰格医药	82,576,591.06	1.73
16	601688	华泰证券	82,054,841.39	1.72
17	300059	东方财富	79,514,327.46	1.66
18	600104	上汽集团	72,986,900.14	1.53
19	603259	药明康德	59,440,521.22	1.24
20	002024	苏宁易购	59,064,627.55	1.24

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。

1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002602	世纪华通	941,994,395.89	19.72
2	600023	浙能电力	536,329,294.11	11.23
3	601607	上海医药	407,884,391.55	8.54
4	601990	南京证券	234,694,953.28	4.91
5	002555	三七互娱	196,672,829.89	4.12
6	600623	华谊集团	158,589,466.66	3.32
7	002304	洋河股份	125,737,828.36	2.63
8	600126	杭钢股份	119,791,905.45	2.51
9	600282	南钢股份	87,415,413.13	1.83
10	600276	恒瑞医药	76,642,551.41	1.60
11	002415	海康威视	74,758,764.80	1.57
12	002142	宁波银行	74,407,423.86	1.56
13	300347	泰格医药	55,061,168.34	1.15
14	601328	交通银行	45,615,138.00	0.95
15	002221	东华能源	35,049,611.94	0.73
16	002463	沪电股份	34,695,282.28	0.73
17	600000	浦发银行	34,381,636.20	0.72
18	300059	东方财富	31,470,984.49	0.66
19	000963	华东医药	29,417,850.83	0.62
20	601211	国泰君安	27,062,697.10	0.57

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。

1.4.3 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	5,788,000,761.55
卖出股票收入（成交）总额	4,115,949,556.10

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。

1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	331,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	331,000.00	0.01

1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110065	淮矿转债	3,310	331,000.00	0.01

1.7 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投资。

1.8 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。

1.9 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。

1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2003	IF2003	105	129,773,700.00	3,171,720.00	-
公允价值变动总额合计（元）					3,171,720.00
股指期货投资本期收益（元）					4,055,417.48
股指期货投资本期公允价值变动（元）					3,171,720.00

1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

1.12 投资组合报告附注

1.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

1.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

1.12.3 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	14,063,992.42
2	应收证券清算款	9,215,186.46
3	应收股利	-
4	应收利息	74,804.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	23,353,983.55
---	----	---------------

1.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:报告期末未持有的处于转股期的可转换债券。

1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

1.12.5.2 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	601916	浙商银行	1,370,948.70	0.03	新股流通受限
2	601077	渝农商行	925,090.28	0.02	新股流通受限
3	688399	硕世生物	124,827.90	0.00	新股流通受限

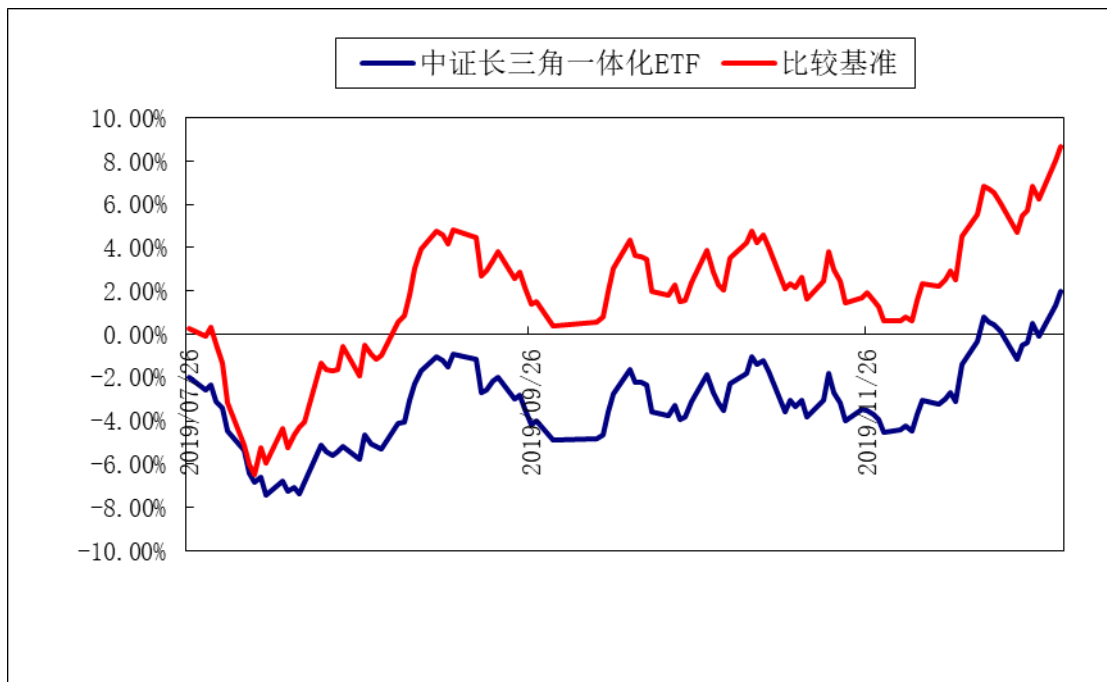
十二、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

阶段	净值增长率 (1)	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)
2019年7月26日(基金合同生效日)至2019年12月31日	1.96%	0.76%	8.66%	0.89%	-6.70%	-0.13%

(二) 自基金合同生效以来基金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图



十三、基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的上市费及年费；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、基金的银行汇划费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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。

2、基金托管人的托管费

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。

3、基金的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费从基金合同生效日开始每日计算,逐日累计,按季支付。由基金管理人向基金托管人发送标的指数指数使用许可费划付指令,经基金托管人复核后,于每年1月、4月、7月、10月的前10个工作日内将上季度标的指数使用许可费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。

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元,若计费期间不足一季度的,则根据实际天数按比例计算。

如果指数使用许可协议约定的标的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费。基金管理人应在招募说明书更新或其他公告中披露本基金最新适用的标的指数许可使用费率、具体计算方法及支付方式。

上述“一、基金费用的种类”中第4—11项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
- 3、《基金合同》生效前的相关费用;
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十四、对招募说明书更新部分的说明

- (一) 根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订，更新《招募说明书》前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的收益与分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容。
- (二) 针对“基金的投资”章节：更新了基金的投资组合报告。
- (三) 针对“基金的业绩”章节：更新了基金的业绩。
- (四) 针对“其他应披露事项”章节：更新了本基金的相关公告。

汇添富基金管理股份有限公司

2020年4月14日