

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 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月27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2021年01月01日起至6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	14
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	15
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	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 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	54
7.1 期末基金资产组合情况	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	66
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	66
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	66
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	66

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12 投资组合报告附注.....	67
§ 8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
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.....	69
§ 9 开放式基金份额变动	69
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	74
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
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.....	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
§ 12 备查文件目录	76
12.1 备查文件目录.....	76
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	添富中证国企一带一路ETF
场内简称	添富国企
基金主代码	515990
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年11月06日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额(份)	431,350,160.00
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	2020年01月15日

注：本基金扩位简称为国企一带一路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、参与融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证国企一带一路指数收益率
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 姓名	李鹏	秦一楠

负责人	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	北京市东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		李文	谷澍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年01月01日 - 2021年06月30日)
本期已实现收益	30,391,264.05
本期利润	57,808,021.71
加权平均基金份额本期利润	0.1252
本期加权平均净值利润率	10.07%
本期基金份额净值增长率	10.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年06月30日)
期末可供分配利润	87,095,447.67
期末可供分配基金份额利润	0.2019
期末基金资产净值	559,875,673.49
期末基金份额净值	1.2980
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	29.80%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收

益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

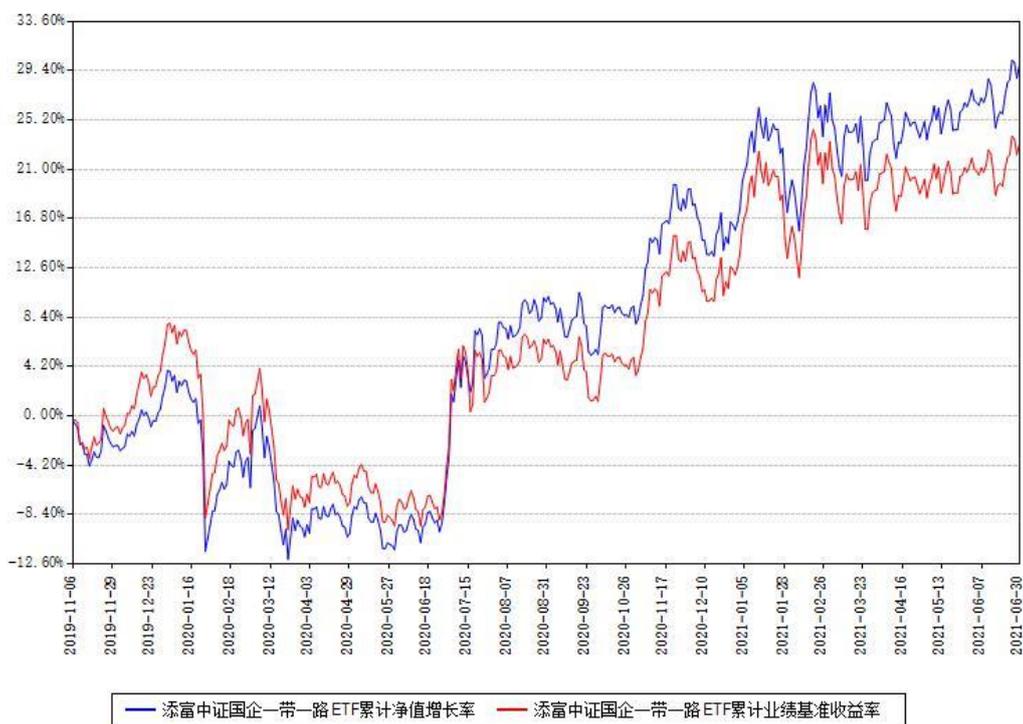
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.29%	0.82%	1.48%	0.81%	0.81%	0.01%
过去三个月	5.04%	0.82%	3.18%	0.84%	1.86%	-0.02%
过去六个月	10.31%	1.16%	8.10%	1.19%	2.21%	-0.03%
过去一年	42.92%	1.19%	34.25%	1.24%	8.67%	-0.05%
自基金合同生效日起至今	29.80%	1.23%	23.08%	1.29%	6.72%	-0.06%

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

添富中证国企一带一路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11月06日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5号文批准，于2005年2月3日正式成立。目前，公司注册资本金为132,724,224元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，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。

2021 上半年，汇添富基金新成立 21 只公开募集证券投资基金，包括 7 只股票型基金、13 只混合型基金、1 只债券型基金。截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 189 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监	2019 年 11 月 06 日		15	国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、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 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7

					<p>日任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日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。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日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。2013年8月23日至2015年11月2日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。2013年11月6日至今任汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015年2月16日至今任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015年3月24日至今任汇添富中证主要消费交易型开放</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>式指数证券投资基金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疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016年7月28日至今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。</p> <p>2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2018年3月23日至今任汇添富沪深300指数增强型证券投资基金的基金经理。</p> <p>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9月24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。</p>
--	--	--	--	--	---

					2019年11月6日至今任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的基金经理。 2020年3月5日至今任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的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人进一步完善了公司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、投资策略及投资品种。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统中的公平交易模块进行操作,实现事前和

事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析，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溢价率进行了T分布检验。对于没有通过检验的交易，再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、根据交易价格、交易频率、交易数量等对不同组合之间的反向交易进行了综合分析。

通过上述管控措施的有效落实，本报告期内，本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易，也未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有14次，投资组合经理因投资组合的投资策略与其他组合发生同日反向交易，相关交易事前严格根据公司内部规定进行审批，事后对其交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现可能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

上半年，国内经济持续保持稳定恢复，就业形势总体稳定，市场活力逐步提升，发展预期向好，内生动力加强。随着统筹疫情防控和经济社会发展成果持续巩固，市场需求稳定恢复，工业企业经营状况不断改善，企业利润持续稳定增长。根据国家统计局数据，1—5月份，全国规模以上工业企业利润同比增长83.4%，比2019年同期增长48.0%，两年平均增长21.7%。6月份，中国制造业采购经理指数、非制造业商务活动指数和综合PMI产出指数分别为50.9%、53.5%和52.9%，均持续位于临界点以上，我国经济运行继续保持扩张态势。

市场情况来看，一季度市场受到通胀预期等的影响出现了较大程度的调整，其中消费、医药、科技等板块调整幅度相对较大。二季度以来通胀预期降温、流动性相对充裕，市场迎来反弹。大部分行业上涨，钢铁、电力设备新能源和基础化工等行业领涨。受通货膨胀预期与大宗商品持续上行的影响，钢铁、基础化工、煤炭等周期风格年初以来大幅上涨，高景气度的电力设备及新能源也涨幅居前。

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目

的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 10.31%。同期业绩比较基准收益率为 8.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球疫情仍在持续演变，外部环境不确定性仍在；国内经济相对来说韧性更足，在高基数影响下，下半年预计季度增速温和回落，整体大概率能够维持稳健。消费有望延续复苏，制造业投资温和回升。

政策方面，根据最新的政治局会议要求，要做好宏观政策跨周期调节，保持宏观政策连续性、稳定性、可持续性，统筹做好今明两年宏观政策衔接，保持经济运行在合理区间。积极的财政政策要提升政策效能，稳健的货币政策要保持流动性合理充裕。国内流动性大概率仍将偏向边际宽松。海外来看，由于全球经济整体处于复苏阶段，美通胀创下新高，就业市场也出现了明显改善，因此美联储已经开始为货币政策正常化做准备。市场对于美联储货币收紧的预期已经较为充分，边际影响可能较小。

下半年市场行情或将延续分化，随着经济恢复常态，产业升级和消费升级所代表的“新经济”和成长风格可能重回主线。碳中和、物联网和先进制造等相关主题的投资机会也值得持续关注。

中证国企一带一路指数以参与一带一路建设的国企上市公司为主要待选样本，从中选取企业盈利质量、成长能力与 ESG 等三个方面整体得分较高的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映受益于一带一路主题的国企上市公司证券在沪深市场的整体表现。国企一带一路指数成份股股息率高、盈利稳定，具备主题性的长期投资价值。

作为被动投资的指数型基金，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，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，实现投资目标。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部、风险管理及合规稽核人员、基金经理等组成了估值委员会，负责

研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	16,291,493.03	16,658,745.25
结算备付金		4,659,933.67	5,467,176.29
存出保证金		799,226.82	257,822.34
交易性金融资产	6.4.7.2	538,662,759.89	586,853,822.49
其中：股票投资		538,398,759.89	586,853,609.13
基金投资		-	-
债券投资		264,000.00	213.36
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	345,715.20
应收利息	6.4.7.5	35,181.21	27,074.37
应收股利		133,776.45	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		560,582,371.07	609,610,355.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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		-	-

应付证券清算款		85,197.10	3,906,752.64
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		69,126.26	88,335.62
应付托管费		23,042.07	29,445.21
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	387,742.63	95,258.94
应交税费		0.35	4.34
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	141,589.17	259,726.95
负债合计		706,697.58	4,379,523.70
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	431,350,160.00	514,350,160.00
未分配利润	6.4.7.1 0	128,525,513.49	90,880,672.24
所有者权益合计		559,875,673.49	605,230,832.24
负债和所有者权益总计		560,582,371.07	609,610,355.94

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2980 元，基金份额总额 431,350,160.00 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
一、收入		59,281,355.66	-390,179,315.02
1. 利息收入		476,037.72	556,289.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	80,690.86	497,254.60
债券利息收入		11.32	777.47
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		395,335.54	58,257.30
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		31,294,758.40	-114,954,577.78
其中：股票投资收益	6.4.7.12	25,980,670.62	-149,233,009.46
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	83.48	-
资产支持证券投资	6.4.7.14.2	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	168,405.00	-
股利收益	6.4.7.17	5,145,599.30	34,278,431.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	27,416,757.66	-275,439,410.17
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	93,801.88	-341,616.44
减：二、费用		1,473,333.95	8,391,045.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	427,087.88	2,169,714.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	142,362.62	723,238.08
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	715,497.99	4,952,339.33
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.04	2.78
7. 其他费用	6.4.7.21	188,385.42	545,751.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		57,808,021.71	-398,570,360.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		57,808,021.71	-398,570,360.64

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	514,350,160.00	90,880,672.24	605,230,832.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	57,808,021.71	57,808,021.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以	-83,000,000.00	-20,163,180.46	-103,163,180.46

“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	1,000,000.00	230,729.11	1,230,729.11
2. 基金赎回款	-84,000,000.00	-20,393,909.57	-104,393,909.57
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）	431,350,160.00	128,525,513.49	559,875,673.49
项目	上年度可比期间		
	2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,624,350,160.00	90,097,109.90	3,714,447,269.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-398,570,360.64	-398,570,360.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,665,000,000.00	128,545,304.07	-1,536,454,695.93
其中：1. 基金申购款	1,201,000,000.00	-101,113,764.22	1,099,886,235.78
2. 基金赎回款	-2,866,000,000.00	229,659,068.29	-2,636,340,931.71
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）	1,959,350,160.00	-179,927,946.67	1,779,422,213.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

李骁

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富中证国企一带一路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”）[2019]1344号《关于准予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注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司于2019年9月11日至2019年10月31日期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2019）验字第60466941_B51号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2019年11月6日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币3,624,319,973.00元，在募集期间产生的利息为人民币30,187.00元，以上实收基金（本息）合计为人民币3,624,350,160.00元，折合3,624,350,160.00份基金份额。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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）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相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。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。本基金业绩比较基准为：中证国企一带一路指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2021年06月30日的财务状况以及2021年01月01日至2021年06月30日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3%调整为1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策

的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款

利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	16,291,493.03
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	16,291,493.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	467,152,750.97	538,398,759.89	71,246,008.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	264,000.00	264,000.00
	银行间市场	-	-
	其他	-	-
	合计	264,000.00	264,000.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	467,416,750.97	538,662,759.89	71,246,008.92

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,019,200.00	-	-	-
（股指期货投资）	6,019,200.00			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,019,200.00	-	-	-

注：本期末2021年6月30日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量(买/卖)	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
IF2109	4	6,019,200.00	6,199,680.00	180,480.00
总额合计：		180,480.00		
减：可抵销期货暂收款		180,480.00		
股指期货投资净额：		0.00		

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	2,547.98
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	1,924.71
应收债券利息	11.57

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	30,674.54
其他	22.41
合计	35,181.21

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	387,742.63
银行间市场应付交易费用	-
合计	387,742.63

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付审计费	39,671.58
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	42,410.22
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	141,589.17

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	514,350,160.00	514,350,160.00

本期申购	1,000,000.00	1,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-84,000,000.00	-84,000,000.00
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	431,350,160.00	431,350,160.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	69,376,015.80	21,504,656.44	90,880,672.24
本期利润	30,391,264.05	27,416,757.66	57,808,021.71
本期基金份额交易产生的变动数	-12,671,832.18	-7,491,348.28	-20,163,180.46
其中：基金申购款	151,523.80	79,205.31	230,729.11
基金赎回款	-12,823,355.98	-7,570,553.59	-20,393,909.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	87,095,447.67	41,430,065.82	128,525,513.49

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	42,056.40
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	37,762.20
其他	872.26
合计	80,690.86

注：“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	18,579,523.33

股票投资收益——赎回差价收入	7,401,147.29
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	25,980,670.62

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	243,052,468.61
减：卖出股票成本总额	224,472,945.28
买卖股票差价收入	18,579,523.33

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
赎回基金份额对价总额	104,393,909.57
减：现金支付赎回款总额	32,543,422.57
减：赎回股票成本总额	64,449,339.71
赎回差价收入	7,401,147.29

6.4.7.12.4 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30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	-

6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	283.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	200.00
减：应收利息总额	0.12
买卖债券差价收入	83.48

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益**6.4.7.16.1 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年01月01日至2021年06月30日
买卖权证差价收入	-
卖出权证成本总额	-
股指期货投资收益	168,405.00
外汇期货投资收益	-
国债期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-
买卖权证差价收入应缴纳增值税	-

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	5,145,599.30
其中：证券出借权益补偿收入	443,541.45
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,145,599.30

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	27,236,277.66
——股票投资	27,236,291.02
——债券投资	-13.36
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	180,480.00
——权证投资	-
——期货投资	180,480.00

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	27,416,757.66

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	93,801.88
其他	-
合计	93,801.88

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	715,497.99
银行间市场交易费用	-
合计	715,497.99

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	3,788.93
指数使用费	85,417.54
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	188,385.42

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
中国农业银行股份有限公司 (“农业银行”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	417,977,881.38	92.90	818,452,778.18	24.23

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	283.60	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 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 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	386,432.51	93.00	378,223.78	97.55
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	759,055.25	24.57	354,051.17	25.26

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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	427,087.88	2,169,714.32
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 2021年01月01日至2021 年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	142,362.62	723,238.08

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 2021 年 01 月 01 日至 2021 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	1,488,416.00	984.01	-	-
上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	125,242,028.00	58,257.30	55,942,285.00	12,533.21

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

注：本基金本报告期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。

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自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自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除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。

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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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
农业银行	16,291,493.03	42,056.40	49,455,284.69	448,406.69

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。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（2021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

301018	申菱环境	2021年06月28日	2022年01月07日	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78
300955	嘉亨家化	2021年03月16日	2021年09月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24
300945	曼卡龙	2021年02月03日	2021年08月10日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12
605287	德才股份	2021年06月28日	2021年07月06日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44
688696	极米科技	2021年02月23日	2021年09月03日	新股流通受限	133.73	780.24	680	90,936.40	530,563.20
300952	恒辉安防	2021年03月03日	2021年09月13日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20
301015	百洋医药	2021年06月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46
300996	普联	2021年	2021年	新股	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43

	软件	05月26日	12月03日	流通受限						
300966	共同药业	2021年03月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	
300991	创益通	2021年05月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	
300992	泰福泵业	2021年05月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	
301010	晶雪节能	2021年06月09日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	
301016	雷尔伟	2021年06月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	
300614	百川畅银	2021年05月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	
300995	奇德新材	2021年05月	2021年11月	新股流通	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	

		17日	26日	受限						
688499	利元亨	2021年06月23日	2021年07月01日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2022年01月05日	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2021年07月05日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	
300973	立高食品	2021年04月08日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	
301018	申菱环境	2021年06月28日	2021年07月07日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	
300957	贝泰妮	2021年03月18日	2021年09月27日	新股流通受限	47.33	251.96	330	15,618.90	83,146.80	
300958	建工修复	2021年03月18日	2021年09月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	

301021	英诺激光	2021年06月28日	2021年07月06日	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14
688367	工大高科	2021年06月21日	2021年12月28日	新股流通受限	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98
688191	智洋创新	2021年03月30日	2021年10月08日	新股流通受限	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22
300993	玉马遮阳	2021年05月17日	2021年11月24日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90
301011	华立科技	2021年06月09日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00
300950	德固特	2021年02月24日	2021年09月03日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47
300942	易瑞生物	2021年02月02日	2021年08月09日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36
300967	晓鸣	2021年	2021年	新股	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78

	股份	04月02日	10月13日	流通受限						
300997	欢乐家	2021年05月26日	2021年12月02日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	
300929	华骐环保	2021年01月12日	2021年07月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	
300943	春晖智控	2021年02月03日	2021年08月10日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	
300972	万辰生物	2021年04月08日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	
301007	德迈仕	2021年06月04日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	
300982	苏文电能	2021年04月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	
300981	中红医疗	2021年04月	2021年10月	新股流通	48.59	90.39	301	14,625.59	27,207.39	

		19 日	27 日	受 限						
300971	博亚精工	2021 年 04 月 07 日	2021 年 10 月 15 日	新 股 流 通 受 限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	
605162	新中港	2021 年 06 月 29 日	2021 年 07 月 07 日	新 股 流 通 受 限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	
300986	志特新材	2021 年 04 月 21 日	2021 年 11 月 01 日	新 股 流 通 受 限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	
301021	英诺激光	2021 年 06 月 28 日	2022 年 01 月 06 日	新 股 流 通 受 限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	
300930	屹通新材	2021 年 01 月 13 日	2021 年 07 月 21 日	新 股 流 通 受 限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	
300968	格林精密	2021 年 04 月 06 日	2021 年 10 月 15 日	新 股 流 通 受 限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	
301012	扬电科技	2021 年 06 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新 股 流 通 受 限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	

688226	威腾电气	2021年06月28日	2021年07月07日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	
300933	中辰股份	2021年01月15日	2021年07月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	
688087	英科再生	2021年06月30日	2021年07月09日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	
300948	冠中生态	2021年02月18日	2021年08月25日	新股流通受限	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	
688395	正弦电气	2021年04月21日	2021年10月29日	新股流通受限	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	
300962	中金辐照	2021年03月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113051	节	2021	2021	新	100.00	100.00	2,640	264,000.00	264,000.00	

	能 转 债	年 06 月 22 日	年 07 月 22 日	债 流 通 受 限						
--	-------------	-------------------------	-------------------------	-----------------------	--	--	--	--	--	--

注：本基金持有的流通受限股票“冠中生态”（证券代码：300948）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108股（根据冠中生态2020年年度权益分派实施公告，冠中生态以公司现有总股本93,340,000股为基数，向全体股东每10股派0.80元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每10股转增5股，除权除息日为2021年6月4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2021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2021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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：张）	期末估值总额
1	601919	中远海控	2021年07月01日 - 2021年07月01日	30.54	106100	3,240,294.00
2	601012	隆基股份	2021年07月01日 - 2021年07月01日	88.84	28700	2,549,708.00
3	600309	万华	2021年07月 - 2021年07月	108.82	18700	2,034,934.00

		化学	月01日	月01日			
4	601866	中远海发	2021年07月01日	2021年07月01日	3.75	463100	1,736,625.00
5	000725	京东方A	2021年07月01日	2021年07月01日	6.24	240400	1,500,096.00
6	002415	海康威视	2021年07月01日	2021年07月01日	64.50	21900	1,412,550.00
7	600755	厦门国贸	2021年07月01日	2021年07月01日	8.21	158600	1,302,106.00
8	000338	潍柴动力	2021年07月01日	2021年07月01日	17.87	71500	1,277,705.00
9	000932	华菱钢铁	2021年07月01日	2021年07月01日	6.60	193000	1,273,800.00
10	600188	兖州煤业	2021年07月01日	2021年07月01日	15.36	81900	1,257,984.00
11	688396	华润微	2021年07月01日	2021年07月01日	91.02	13700	1,246,974.00
12	000039	中集集团	2021年07月01日	2021年07月01日	18.18	68000	1,236,240.00
13	000830	鲁西化工	2021年07月01日	2021年07月01日	18.73	62900	1,178,117.00
14	000625	长安	2021年07月01日	2021年07月01日	26.28	44700	1,174,716.00

		汽车	月 01 日	月 01 日				
15	000807	云铝股份	2021 年 07 月 01 日	-	2021 年 07 月 01 日	11.90	90700	1,079,330.00
16	601899	紫金矿业	2021 年 07 月 01 日	-	2021 年 07 月 01 日	9.69	106900	1,035,861.00
17	002080	中材科技	2021 年 07 月 01 日	-	2021 年 07 月 01 日	26.17	37300	976,141.00
18	600039	四川路桥	2021 年 07 月 01 日	-	2021 年 07 月 01 日	6.27	155500	974,985.00
19	000157	中联重科	2021 年 07 月 01 日	-	2021 年 07 月 01 日	9.24	96600	892,584.00
20	002092	中泰化学	2021 年 07 月 01 日	-	2021 年 07 月 01 日	10.27	84500	867,815.00
21	600026	中远海能	2021 年 07 月 01 日	-	2021 年 07 月 01 日	6.16	140100	863,016.00
22	600166	福田汽车	2021 年 07 月 05 日	-	2021 年 07 月 12 日	3.45	242100	835,245.00
23	600426	华鲁恒升	2021 年 07 月 05 日	-	2021 年 07 月 12 日	30.95	26400	817,080.00
24	600409	三友化工	2021 年 07 月 05 日	-	2021 年 07 月 05 日	10.11	79200	800,712.00
25	002179	中航	2021 年 07	-	2021 年 07	79.02	10000	790,200.00

		光电	月01日	月01日			
26	002142	宁波银行	2021年07月01日	2021年07月01日	38.97	19400	756,018.00
27	600871	石化油服	2021年07月01日	2021年07月05日	1.97	380500	749,585.00
28	600028	中国石化	2021年07月01日	2021年07月01日	4.36	168900	736,404.00
29	002281	光迅科技	2021年07月01日	2021年07月01日	24.60	29800	733,080.00
30	601390	中国中铁	2021年07月01日	2021年07月01日	5.24	134300	703,732.00
31	600968	海油发展	2021年07月01日	2021年07月01日	2.59	267500	692,825.00
32	601088	中国神华	2021年07月01日	2021年07月01日	19.52	34700	677,344.00
33	601985	中国核电	2021年07月01日	2021年07月01日	5.06	133400	675,004.00
34	600900	长江电力	2021年07月01日	2021年07月01日	20.64	32500	670,800.00
35	000488	晨鸣纸业	2021年07月01日	2021年07月01日	8.14	80800	657,712.00
36	000519	中兵	2021年07月01日	2021年07月01日	10.72	58900	631,408.00

		红 箭	月 01 日	月 01 日			
37	600153	建 发 股 份	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 05 日	8.10	76700	621,270.00
38	601668	中 国 建 筑	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	4.65	133500	620,775.00
39	601717	郑 煤 机	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	11.63	53100	617,553.00
40	000528	柳 工	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 12 日	8.20	75200	616,640.00
41	600008	首 创 环 保	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	3.01	204500	615,545.00
42	002110	三 钢 闽 光	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	6.74	88300	595,142.00
43	600299	安 迪 苏	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	11.96	48800	583,648.00
44	600050	中 国 联 通	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	4.32	135000	583,200.00
45	000581	威 孚 高 科	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	20.83	27300	568,659.00
46	600497	驰 宏 锌 锗	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	4.31	127400	549,094.00
47	601298	青 岛	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	6.18	78800	486,984.00

		港	月 01	月 01			
			日	日			
48	000060	中金岭南	2021年07月01日	2021年07月01日	4.52	103600	468,272.00
49	601117	中国化学	2021年07月01日	2021年07月01日	8.76	52900	463,404.00
50	601186	中国铁建	2021年07月01日	2021年07月01日	7.43	60100	446,543.00
51	000977	浪潮信息	2021年07月01日	2021年07月01日	28.13	15100	424,763.00
52	600362	江西铜业	2021年07月01日	2021年07月01日	22.38	18900	422,982.00
53	601975	招商南油	2021年07月01日	2021年07月01日	2.14	178900	382,846.00
54	601872	招商轮船	2021年07月01日	2021年07月01日	4.62	80160	370,339.20
55	601238	广汽集团	2021年07月01日	2021年07月01日	12.95	27700	358,715.00
56	601869	长飞光纤	2021年07月01日	2021年07月01日	24.36	14200	345,912.00
57	000877	天山股份	2021年07月01日	2021年07月01日	13.03	26200	341,386.00
58	600332	白云	2021年07月01日	2021年07月01日	33.85	10000	338,500.00

		山	月 01 日	月 01 日			
59	601800	中国 交建	2021 年 07 月 05 日	- 2021 年 07 月 12 日	6.48	48100	311,688.00
60	600970	中材 国际	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	9.17	32200	295,274.00
61	601016	节能 风电	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	3.74	77900	291,346.00
62	600704	物产 中大	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	7.87	33300	262,071.00
63	601669	中国 电建	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	3.87	65400	253,098.00
64	601618	中国 中冶	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 12 日	2.98	52200	155,556.00
65	601598	中国 外运	2021 年 07 月 05 日	- 2021 年 07 月 05 日	5.05	22800	115,140.00
合计	-	-	-	-	-	5,951,460	52,545,075.20

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。

除在附注6.4.12中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外,本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 06月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	16,291,493.03	-	-	-	-	-	16,291,493.03
结算备付金	4,659,933.67	-	-	-	-	-	4,659,933.67
存出保证金	55,265.22	-	-	-	-	743,961.60	799,226.82
交易性金融资产	-	-	264,000.00	-	-	538,398,759.89	538,662,759.89
应收股利	-	-	-	-	-	133,776.45	133,776.45
应收利息	-	-	-	-	-	35,181.21	35,181.21
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
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	21,006,691.92	-	264,000.00	-	-	539,311,679.15	560,582,371.07
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	69,126.26	69,126.26
应付 托管 费	-	-	-	-	-	23,042.07	23,042.07
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	85,197.10	85,197.10
卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	387,742.63	387,742.63
应交 税费	-	-	-	-	-	0.35	0.35
应付 利息	-	-	-	-	-	-	-
应付	-	-	-	-	-	-	-

利润							
其他 负债	-	-	-	-	-	141,589.17	141,589.17
负债 总计	-	-	-	-	-	706,697.58	706,697.58
利率 敏感 度缺 口	21,006,691.92	-	264,000.00	-	-	538,604,981.57	559,875,673.49
上年 度末 2020 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	16,658,745.25	-	-	-	-	-	16,658,745.25
结算 备付 金	5,467,176.29	-	-	-	-	-	5,467,176.29
存出 保证 金	257,822.34	-	-	-	-	-	257,822.34
交易 性金 融资 产	-	-	213.36	-	-	586,853,609.13	586,853,822.49
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 利息	-	-	-	-	-	27,074.37	27,074.37
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	345,715.20	345,715.20

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	22,383,743.88	-	213.36	-	-	587,226,398.70	609,610,355.94
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	88,335.62	88,335.62
应付托管费	-	-	-	-	-	29,445.21	29,445.21
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,906,752.64	3,906,752.64
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	95,258.94	95,258.94
应交税费	-	-	-	-	-	4.34	4.34
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	259,726.95	259,726.95
负债	-	-	-	-	-	4,379,523.70	4,379,523.70

总计							
利率敏感 度缺 口	22,383,743.88	-	213.36	-	-	582,846,875.00	605,230,832.24

注：上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转债债券和可交换债券。因此，除在交易所交易的可转换债券和可交换债券外，本基金本报告期及上年度末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 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	538,398,759.89	96.16	586,853,609.13	96.96
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	264,000.00	0.05	213.36	0.00
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	538,662,759.89	96.21	586,853,822.49	96.96
----	----------------	-------	----------------	-------

注：本基金的投资组合比例为：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。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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	中证国企一带一路指数下跌 5%	-26,665,641.39	-28,751,880.36
	中证国企一带一路指数上涨 5%	26,665,641.39	28,751,880.36

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	538,398,759.89	96.04
	其中：股票	538,398,759.89	96.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	264,000.00	0.05

	其中：债券	264,000.00	0.05
	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	20,951,426.70	3.74
8	其他资产	968,184.48	0.17
9	合计	560,582,371.07	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 52,545,075.20 元，占期末基金资产净值比例 9.39%。

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	-	-
B	采矿业	44,731,057.12	7.99
C	制造业	312,474,831.71	55.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,768,773.90	2.82
E	建筑业	37,543,318.33	6.71
F	批发和零售业	14,205,270.00	2.54
G	交通运输、仓储和邮政业	52,842,782.56	9.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,278,880.04	3.98
J	金融业	10,023,565.00	1.79
K	房地产业	5,457,480.00	0.97
L	租赁和商务服务业	14,086,694.00	2.52
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	529,412,652.66	94.56

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	207,418.70	0.04
B	采矿业	87,263.74	0.02

C	制造业	6,710,284.17	1.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,286.79	0.01
E	建筑业	195,927.08	0.03
F	批发和零售业	309,237.90	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	27,865.35	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	312,779.21	0.06
J	金融业	97,319.40	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	65,464.36	0.01
M	科学研究和技术服务业	312,964.80	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	572,033.70	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,262.03	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,986,107.23	1.61

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	601919	中远海控	689,200	21,048,168.00	3.76
2	601012	隆基股份	186,360	16,556,222.40	2.96
3	601888	中国中免	46,940	14,086,694.00	2.52
4	600309	万华化学	121,914	13,266,681.48	2.37
5	601866	中远海发	3,007,600	11,278,500.00	2.01
6	000799	酒鬼酒	41,800	10,684,080.00	1.91

7	000100	TCL 科技	1,392,200	10,650,330.00	1.90
8	600887	伊利股份	274,176	10,097,902.08	1.80
9	000725	京东方 A	1,561,500	9,743,760.00	1.74
10	002281	光迅科技	378,963	9,322,489.80	1.67
11	002415	海康威视	143,100	9,229,950.00	1.65
12	600050	中国联通	2,052,500	8,866,800.00	1.58
13	600755	厦门国贸	1,030,400	8,459,584.00	1.51
14	000338	潍柴动力	464,700	8,304,189.00	1.48
15	000932	华菱钢铁	1,253,300	8,271,780.00	1.48
16	600188	兖州煤业	532,200	8,174,592.00	1.46
17	688396	华润微	89,612	8,156,484.24	1.46
18	000039	中集集团	441,800	8,031,924.00	1.43
19	002179	中航光电	101,100	7,988,922.00	1.43
20	603927	中科软	184,400	7,919,980.00	1.41
21	000830	鲁西化工	408,600	7,653,078.00	1.37
22	000625	长安汽车	290,900	7,644,852.00	1.37
23	600166	福田汽车	2,188,600	7,550,670.00	1.35
24	000807	云铝股份	589,800	7,018,620.00	1.25
25	600409	三友化工	685,400	6,929,394.00	1.24
26	601899	紫金矿业	694,300	6,727,767.00	1.20
27	002202	金风科技	548,502	6,669,784.32	1.19
28	600426	华鲁恒升	215,100	6,657,345.00	1.19
29	000596	古井贡酒	26,600	6,370,700.00	1.14

30	601598	中国外运	1,259,200	6,358,960.00	1.14
31	002080	中材科技	242,900	6,356,693.00	1.14
32	600039	四川路桥	1,009,800	6,331,446.00	1.13
33	000157	中联重科	679,400	6,277,656.00	1.12
34	000528	柳工	758,700	6,221,340.00	1.11
35	600871	石化油服	3,076,900	6,061,493.00	1.08
36	600436	片仔癀	13,200	5,917,560.00	1.06
37	002092	中泰化学	549,200	5,640,284.00	1.01
38	600026	中远海能	910,400	5,608,064.00	1.00
39	600406	国电南瑞	236,321	5,492,100.04	0.98
40	001979	招商蛇口	498,400	5,457,480.00	0.97
41	600600	青岛啤酒	46,900	5,423,985.00	0.97
42	601857	中国石油	1,025,200	5,423,308.00	0.97
43	000786	北新建材	132,799	5,212,360.75	0.93
44	600036	招商银行	94,000	5,093,860.00	0.91
45	000977	浪潮信息	176,310	4,959,600.30	0.89
46	002142	宁波银行	126,500	4,929,705.00	0.88
47	600028	中国石化	1,114,900	4,860,964.00	0.87
48	600597	光明乳业	333,900	4,811,499.00	0.86
49	601390	中国中铁	872,600	4,572,424.00	0.82
50	000425	徐工机械	714,000	4,548,180.00	0.81
51	600968	海油发展	1,737,500	4,500,125.00	0.80

52	601088	中国神 华	225,667	4,405,019.84	0.79
53	600176	中国巨 石	283,254	4,393,269.54	0.78
54	601985	中国核 电	866,900	4,386,514.00	0.78
55	600900	长江电 力	211,800	4,371,552.00	0.78
56	002916	深南电 路	38,893	4,322,179.09	0.77
57	601618	中国中 冶	1,446,764	4,311,356.72	0.77
58	000488	晨鸣纸 业	524,700	4,271,058.00	0.76
59	000519	中兵红 箭	383,200	4,107,904.00	0.73
60	601186	中国铁 建	551,400	4,096,902.00	0.73
61	600153	建发股 份	498,700	4,039,470.00	0.72
62	601668	中国建 筑	867,300	4,032,945.00	0.72
63	601717	郑煤机	345,500	4,018,165.00	0.72
64	600008	首创环 保	1,328,490	3,998,754.90	0.71
65	002110	三钢闽 光	573,600	3,866,064.00	0.69
66	600299	安迪苏	316,988	3,791,176.48	0.68
67	000581	威孚高 科	177,800	3,703,574.00	0.66
68	600497	驰宏锌 锗	857,900	3,697,549.00	0.66
69	000661	长春高 新	9,500	3,676,500.00	0.66
70	600820	隧道股 份	643,809	3,405,749.61	0.61
71	600362	江西铜 业	148,433	3,321,930.54	0.59
72	601298	青岛港	512,500	3,167,250.00	0.57
73	600563	法拉电 子	19,800	3,135,528.00	0.56
74	000060	中金岭 南	673,400	3,043,768.00	0.54

75	601117	中国化学	343,900	3,012,564.00	0.54
76	600104	上汽集团	132,700	2,915,419.00	0.52
77	600585	海螺水泥	69,700	2,861,185.00	0.51
78	600019	宝钢股份	371,100	2,835,204.00	0.51
79	601975	招商南油	1,162,300	2,487,322.00	0.44
80	601872	招商轮船	520,588	2,405,116.56	0.43
81	601238	广汽集团	180,700	2,340,065.00	0.42
82	601869	长飞光纤	92,600	2,255,736.00	0.40
83	000877	天山股份	170,500	2,221,615.00	0.40
84	600332	白云山	65,500	2,217,175.00	0.40
85	600498	烽火通信	115,963	2,160,390.69	0.39
86	601800	中国交建	330,300	2,140,344.00	0.38
87	600970	中材国际	209,500	1,921,115.00	0.34
88	601016	节能风电	506,500	1,894,310.00	0.34
89	600486	扬农化工	16,900	1,888,913.00	0.34
90	600170	上海建工	672,500	1,856,100.00	0.33
91	600704	物产中大	216,800	1,706,216.00	0.30
92	601669	中国电建	425,300	1,645,911.00	0.29
93	601727	上海电气	321,500	1,363,160.00	0.24
94	000738	航发控制	64,300	1,339,369.00	0.24
95	600886	国投电力	116,300	1,117,643.00	0.20
96	601808	中海油服	61,298	880,239.28	0.16

97	600018	上港集团	102,600	489,402.00	0.09
98	600068	葛洲坝	28,900	216,461.00	0.04
99	600737	中粮糖业	21,500	215,215.00	0.04
100	601766	中国中车	6,900	41,952.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	688696	极米科技	680	530,563.20	0.09
2	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.07
3	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.06
4	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.05
5	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.04
6	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.04
7	300912	凯龙高科	5,117	200,432.89	0.04
8	688315	诺禾致源	3,711	181,096.80	0.03
9	300968	格林精密	11,520	177,681.74	0.03
10	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.03
11	300982	苏文电能	3,170	173,982.28	0.03
12	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.03
13	300997	欢乐家	9,179	166,899.16	0.03
14	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.03
15	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.03
16	688323	瑞华泰	4,513	142,565.67	0.03
17	300962	中金辐照	5,757	133,773.12	0.02
18	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.02
19	300996	普联软件	2,410	132,487.34	0.02
20	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.02
21	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.02
22	300966	共同药业	2,858	126,586.56	0.02
23	300933	中辰股份	11,017	116,404.18	0.02
24	300955	嘉亨家化	2,314	115,870.88	0.02
25	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
26	688201	信安世纪	2,129	111,240.25	0.02
27	688639	华恒生物	2,302	110,472.98	0.02

28	300986	志特新材	2,632	103,429.84	0.02
29	688636	智明达	918	97,583.40	0.02
30	300952	恒辉安防	3,398	95,320.48	0.02
31	688113	联测科技	1,415	93,107.00	0.02
32	688533	上声电子	3,493	91,865.90	0.02
33	300950	德固特	2,186	89,334.49	0.02
34	300991	创益通	2,535	89,214.50	0.02
35	688468	科美诊断	3,919	87,432.89	0.02
36	300958	建工修复	2,993	86,747.74	0.02
37	300971	博亚精工	2,445	84,503.05	0.02
38	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
39	300957	贝泰妮	330	83,146.80	0.01
40	300967	晓鸣股份	5,061	81,674.88	0.01
41	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.01
42	300930	屹通新材	3,220	80,013.78	0.01
43	605117	德业股份	627	80,005.20	0.01
44	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.01
45	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.01
46	001203	大中矿业	3,809	76,751.35	0.01
47	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.01
48	300972	万辰生物	4,300	71,539.10	0.01
49	688663	新风光	3,279	71,023.14	0.01
50	688611	杭州柯林	1,400	68,726.00	0.01
51	688685	迈信林	2,612	67,781.40	0.01
52	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
53	688655	迅捷兴	3,083	62,893.20	0.01
54	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
55	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.01
56	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
57	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.01
58	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.01
59	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.01
60	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.01
61	300929	华骐环保	1,827	54,892.05	0.01
62	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
63	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.01
64	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.01
65	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
66	688565	力源科技	2,464	44,376.64	0.01
67	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
68	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.01
69	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.01
70	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.01

71	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.01
72	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.01
73	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.01
74	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
75	605089	味知香	370	32,197.40	0.01
76	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.01
77	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
78	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.00
79	300981	中红医疗	301	27,207.39	0.00
80	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
81	603324	盛剑环境	733	26,666.54	0.00
82	603759	海天股份	1,119	22,939.50	0.00
83	605268	王力安防	1,642	22,659.60	0.00
84	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
85	605378	野马电池	473	21,729.62	0.00
86	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.00
87	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.00
88	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
89	300884	狄耐克	748	20,106.24	0.00
90	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
91	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
92	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
93	300898	熊猫乳品	496	17,984.96	0.00
94	605208	永茂泰	801	17,485.83	0.00
95	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
96	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
97	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
98	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
99	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
100	605299	舒华体育	738	15,874.38	0.00
101	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
102	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
103	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
104	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
105	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
106	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
107	003036	泰坦股份	776	11,958.16	0.00
108	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
109	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
110	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
111	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
112	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
113	003038	鑫铂股份	383	10,463.56	0.00

114	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
115	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
116	003033	征和工业	301	9,538.69	0.00
117	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
118	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
119	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
120	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
121	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
122	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
123	605011	杭州热电	525	4,662.00	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	601012	隆基股份	15,313,234.00	2.53
2	000100	TCL科技	11,018,232.00	1.82
3	000799	酒鬼酒	10,478,824.00	1.73
4	600755	厦门国贸	8,786,185.83	1.45
5	000807	云铝股份	8,519,095.00	1.41
6	002179	中航光电	7,747,613.00	1.28
7	600166	福田汽车	7,704,369.00	1.27
8	600426	华鲁恒升	7,543,863.00	1.25
9	600409	三友化工	7,468,700.58	1.23
10	000625	长安汽车	7,116,200.71	1.18
11	688396	华润微	6,931,563.43	1.15
12	600871	石化油服	6,415,818.00	1.06
13	000596	古井贡酒	6,306,172.00	1.04
14	600309	万华化学	6,180,038.00	1.02
15	601598	中国外运	6,140,500.00	1.01
16	600887	伊利股份	5,977,857.57	0.99
17	001979	招商蛇口	5,761,176.00	0.95
18	600436	片仔癀	5,599,415.00	0.93
19	600597	光明乳业	5,393,554.65	0.89
20	600036	招商银行	5,340,724.00	0.88

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	002242	九阳股份	8,307,081.00	1.37
2	002475	立讯精密	7,188,642.93	1.19
3	600256	广汇能源	7,133,144.64	1.18
4	603712	七一二	6,396,333.12	1.06
5	600563	法拉电子	5,906,397.00	0.98
6	600348	华阳股份	5,898,045.00	0.97
7	600704	物产中大	5,757,678.00	0.95
8	601016	节能风电	5,712,790.00	0.94
9	000738	航发控制	5,698,669.82	0.94
10	002463	沪电股份	5,558,398.00	0.92
11	601872	招商轮船	5,423,262.00	0.90
12	600522	中天科技	5,247,264.34	0.87
13	600745	闻泰科技	5,127,255.00	0.85
14	600729	重庆百货	4,948,178.00	0.82
15	601808	中海油服	4,696,236.00	0.78
16	600486	扬农化工	4,636,920.00	0.77
17	600737	中粮糖业	4,408,128.00	0.73
18	002683	宏大爆破	4,360,565.00	0.72
19	601975	招商南油	4,346,052.77	0.72
20	000778	新兴铸管	4,286,915.00	0.71

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	212,374,020.73
卖出股票收入（成交）总额	243,052,468.61

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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）	264,000.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	264,000.00	0.05

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113051	节能转债	2,640	264,000.00	0.05

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 （买/ 卖）	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2109	IF2109	4.00	6,199,680.00	180,480.00	
公允价值变动总额合计					180,480.00
股指期货投资本期收益					168,405.00
股指期货投资本期公允价值变动					180,480.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	799,226.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	133,776.45
4	应收利息	35,181.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	968,184.48

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

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	601919	中远海控	3,240,294.00	0.58	转融通出借流通受限
2	601012	隆基股份	2,549,708.00	0.46	转融通出借流通受限
3	600309	万华化学	2,034,934.00	0.36	转融通出借流通受限
4	601866	中远海发	1,736,625.00	0.31	转融通出借流通受限

5	000725	京东方A	1,500,096.00	0.27	转融通出借流通受限
6	002281	光迅科技	733,080.00	0.13	转融通出借流通受限

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	688696	极米科技	530,563.20	0.09	新股流通受限
2	301015	百洋医药	17,939.46	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		中国农业银行股份有限公司-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	
		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(%)
339	1,272,419.35	429,634,175.00	99.60	1,715,985.00	0.40	101,966,500.00	23.64

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“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”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	中国冶金科工集	201,666,740.00	46.75

	团有限公司		
2	中国交通建设集团有限公司	126,000,036.00	29.21
3	钱中明	765,300.00	0.18
4	冯有双	80,400.00	0.02
5	雷雁鸿	50,000.00	0.01
6	刘锦旋	30,000.00	0.01
7	魏安宝	30,000.00	0.01
8	叶沃明	28,400.00	0.01
9	陈飞跃	26,600.00	0.01
10	孔清培	22,500.00	0.01
11	中国农业银行股份有限公司—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	101,966,500.00	23.64

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年11月06日） 基金份额总额	3,624,350,160.00
本报告期期初基金份额总额	514,350,160.00
本报告期基金总申购份额	1,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	84,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	431,350,160.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

2021年5月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	3	417,977,881.38	92.90	386,432.51	93.00	
国泰君安	2	31,940,996.29	7.10	29,107.94	7.00	
渤海证券	2	-	-	-	-	

财通 证券	1	-	-	-	-	
长城 证券	1	-	-	-	-	
长江 证券	2	-	-	-	-	
东方 财富	2	-	-	-	-	
东海 证券	2	-	-	-	-	
方正 证券	2	-	-	-	-	
国金 证券	1	-	-	-	-	
国联 证券	1	-	-	-	-	
海通 证券	2	-	-	-	-	
恒泰 证券	2	-	-	-	-	
华宝 证券	1	-	-	-	-	
华创 证券	1	-	-	-	-	
华泰 证券	2	-	-	-	-	
华西 证券	2	-	-	-	-	
民生 证券	2	-	-	-	-	
兴业 证券	2	-	-	-	-	
招商 证券	2	-	-	-	-	
中金 公司	2	-	-	-	-	
中泰 证券	1	-	-	-	-	
中信 建投 证券	2	-	-	-	-	
中信 证券	1	-	-	-	-	

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	283.60	100.00	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 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	汇添富基金旗下 164 只基金 2020 年 4 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 01 月 22 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2020 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 03 月 30 日
3	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	2021 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金修订的招募说明书、产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 02 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 22 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加第一创业为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 05 月 19 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中信证券华南为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 06 月 09 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 06 月 24 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中金财富证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 06 月 29 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		20%的时间区间					
机构	1	2021年1月1日至2021年6月30日	201,666,740.00	-	-	201,666,740.00	46.75
	2	2021年1月1日至2021年6月30日	126,000,036.00	-	-	126,000,036.00	29.21
中国农业银行股份有限公司—汇添富中证国企一带	1	2021年1月1日至2021年6月30日	171,935,000.00	31,500.00	70,000,000.00	101,966,500.00	23.64

一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金							
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、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>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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准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募集的文件；
- 2、《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基金合同》；
- 3、《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国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼20楼 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 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08月31日