

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 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	19
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	19
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
6.4 报表附注	23
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	52
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	52
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	52
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	52

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 本报告期投资基金情况.....	52
7.13 投资组合报告附注.....	53
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
8.3 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.....	54
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 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联接基金	
基金简称	添富中证国企一带一路ETF联接	
基金主代码	008907	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年03月05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）	103,456,621.31	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	添富中证国企一带一路ETF联接A	添富中证国企一带一路ETF联接C
下属分级基金的交易代码	008907	008908
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	92,561,499.93	10,895,121.38

2.1.1 目标基金基本情况

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
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标ETF，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	本基金主要投资于目标ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金不参与目标ETF的投资管理。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；目标ETF的投资策略；成份股、备选成份股投资策略；债券投资策略；可转换债券投资策略；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*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为汇添富中证国企一带一路ETF的联接基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,本基金通过投资目标ETF,紧密跟踪标的指数,具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

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 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	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	《上海证券报》
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	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼

§ 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)	
	添富中证国企一带一路ETF联接 A	添富中证国企一带一路ETF联接 C
本期已实现收益	20,510,604.77	1,915,625.95
本期利润	15,153,535.17	1,472,105.88
加权平均基金份额本期利润	0.1350	0.1326
本期加权平均净值利润率	10.14%	9.98%
本期基金份额净值增长率	9.54%	9.38%
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	35,804,866.87	4,154,826.28
期末可供分配基金份额利润	0.3868	0.3813
期末基金资产净值	128,366,366.80	15,049,947.66
期末基金份额净值	1.3868	1.3813
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	38.68%	38.13%

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

添富中证国企一带一路ETF联接A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.11%	0.78%	1.41%	0.77%	0.70%	0.01%
过去三个月	4.65%	0.78%	3.03%	0.80%	1.62%	-0.02%
过去六个月	9.54%	1.10%	7.73%	1.13%	1.81%	-0.03%
过去一年	41.42%	1.15%	32.43%	1.18%	8.99%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	38.68%	1.04%	18.72%	1.15%	19.96%	-0.11%
添富中证国企一带一路ETF联接C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.08%	0.78%	1.41%	0.77%	0.67%	0.01%
过去三个月	4.57%	0.78%	3.03%	0.80%	1.54%	-0.02%
过去六个月	9.38%	1.10%	7.73%	1.13%	1.65%	-0.03%
过去一年	41.01%	1.15%	32.43%	1.18%	8.58%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	38.13%	1.04%	18.72%	1.15%	19.41%	-0.11%

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联接A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



添富中证国企一带一路ETF联接C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2020年03月05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		
董瑾	本基金的基金经理	2020年03月05日		12	国籍:中国。学历:北京大学西方经济学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2010年8月至2012年12月任国泰基金管理有限公司产品经理助理,2012年12月至2015年9月任汇添富基金

					<p>管理股份有限公司产品经理，2015 年 9 月至 2016 年 10 月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2019 年 12 月 4 日至今任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>12月31日至今任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2019年12月31日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。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。2021年2月1日至今任汇添富中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2020年03月05日		15	<p>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</p>

					<p>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 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</p>
--	--	--	--	--	--

				<p>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</p>
--	--	--	--	---

					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。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内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 A 类基金份额净值增长率为 9.54%;C 类基金份额净值增长率为 9.38%。同期业绩比较基准收益率为 7.73%。

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验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

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

《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联接基金

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	9,419,284.74	12,755,287.98
结算备付金		-	-
存出保证金		21,987.79	293,398.93
交易性金融资产	6.4.7.2	136,136,759.52	207,984,527.76
其中：股票投资		3,782,242.52	5,668,613.26
基金投资		132,352,517.00	202,315,914.50
债券投资		2,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		83,540.47	1,247,126.18
应收利息	6.4.7.5	1,748.27	2,765.64
应收股利		-	-
应收申购款		374,099.99	159,078.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		146,037,420.78	222,442,184.96
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		-	-
应付赎回款		2,502,098.22	2,726,748.64
应付管理人报酬		1,496.48	2,395.08
应付托管费		498.80	798.36
应付销售服务费		3,770.89	4,748.61
应付交易费用	6.4.7.7	14,062.98	2,847.75
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	99,178.95	150,000.00
负债合计		2,621,106.32	2,887,538.44
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	103,456,621.31	173,464,934.09
未分配利润	6.4.7.1 0	39,959,693.15	46,089,712.43
所有者权益合计		143,416,314.46	219,554,646.52
负债和所有者权益总计		146,037,420.78	222,442,184.96

注：1、报告截止日2021年06月30日，基金份额总额103,456,621.31份。本基金下属A类基金份额净值1.3868元，基金份额总额92,561,499.93份；本基金下属C类基金份额净值1.3813元，基金份额总额10,895,121.38份。

2、本基金合同生效日为2020年03月05日，上年度实际可比期间为2020年03月05日至2020年12月31日，特此说明。

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联接基金

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03月05日 (基金合同生效日) 至2020年06月30 日
一、收入		16,894,195.49	-29,799,634.75
1. 利息收入		38,109.14	1,783,227.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	38,109.05	1,326,712.74
债券利息收入		0.09	119.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	456,394.35
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		22,643,342.13	-22,470,000.15
其中：股票投资收益	6.4.7.12	300,611.26	-24,245,475.66
基金投资收益	6.4.7.13	22,303,453.46	-515,301.02
债券投资收益	6.4.7.14	-	24,917.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	39,277.41	2,265,859.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-5,800,589.67	-9,115,513.98
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	13,333.89	2,652.36
减：二、费用		268,554.44	2,507,862.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,619.35	504,244.26
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,539.74	168,081.43
3. 销售服务费		22,006.77	45,832.65
4. 交易费用	6.4.7.20	130,181.21	1,715,492.58
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.45
7. 其他费用	6.4.7.21	102,207.37	74,211.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,625,641.05	-32,307,497.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,625,641.05	-32,307,497.57

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联接基金

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)	173,464,934.09	46,089,712.43	219,554,646.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	16,625,641.05	16,625,641.05
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)	-70,008,312.78	-22,755,660.33	-92,763,973.11
其中：1. 基金申购款	48,346,442.27	16,027,983.64	64,374,425.91
2. 基金赎回款	-118,354,755.05	-38,783,643.97	-157,138,399.02
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)	103,456,621.31	39,959,693.15	143,416,314.46
项目	上年度可比期间 2020年03月05日(基金合同生效日)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)	1,782,334,807.41	-	1,782,334,807.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-32,307,497.57	-32,307,497.57
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-670,941,243.76	10,675,908.11	-660,265,335.65

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	16,989,162.42	-271,343.05	16,717,819.37
2. 基金赎回款	-687,930,406.18	10,947,251.16	-676,983,155.02
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)	1,111,393,563.65	-21,631,589.46	1,089,761,974.19

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联接基金（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]1345号文《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联接基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司于2020年1月23日至2020年2月28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（2020）验字第60466941_B05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2020年3月5日生效。本基金为契约型开放式，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1,781,554,774.63元，在募集期间产生的利息为人民币780,032.78元，以上实收基金（本息）合计为人民币1,782,334,807.41元，折合1,782,334,807.41份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（分离交易可转债）等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款）、货币市场工具、金融衍生工具（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转融通证券出借业务。本基金通过投资于目标ETF，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：中证国企一带一路指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

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	9,419,284.74
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	9,419,284.74

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	3,561,262.20	3,782,242.52	220,980.32
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,000.00	2,000.00
	银行间市场	-	-
	其他	-	-
	合计	2,000.00	2,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	93,815,704.08	132,352,517.00	38,536,812.92
其他	-	-	-
合计	97,378,966.28	136,136,759.52	38,757,793.24

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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	1,739.27
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	-

应收债券利息	0.09
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	8.91
合计	1,748.27

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	14,062.98
银行间市场应付交易费用	-
合计	14,062.98

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	-
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	99,178.95

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

添富中证国企一带一路ETF联接A	
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	158,490,693.40	158,490,693.40
本期申购	26,193,422.35	26,193,422.35
本期赎回（以“-”号填列）	-92,122,615.82	-92,122,615.82
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	92,561,499.93	92,561,499.93
添富中证国企一带一路ETF联接C		
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	14,974,240.69	14,974,240.69
本期申购	22,153,019.92	22,153,019.92
本期赎回（以“-”号填列）	-26,232,139.23	-26,232,139.23
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	10,895,121.38	10,895,121.38

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

添富中证国企一带一路ETF联接A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	41,552,083.80	601,657.78	42,153,741.58
本期利润	20,510,604.77	-5,357,069.60	15,153,535.17
本期基金份额交易产生的变动数	-22,273,920.51	771,510.63	-21,502,409.88
其中：基金申购款	9,392,600.50	-742,526.44	8,650,074.06
基金赎回款	-31,666,521.01	1,514,037.07	-30,152,483.94
本期已分配	-	-	-

利润			
本期末	39,788,768.06	-3,983,901.19	35,804,866.87
添富中证国企一带一路ETF联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,879,041.45	56,929.40	3,935,970.85
本期利润	1,915,625.95	-443,520.07	1,472,105.88
本期基金份额交易产生的变动数	-1,172,266.36	-80,984.09	-1,253,250.45
其中:基金申购款	8,280,289.33	-902,379.75	7,377,909.58
基金赎回款	-9,452,555.69	821,395.66	-8,631,160.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,622,401.04	-467,574.76	4,154,826.28

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	37,456.84
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	29.67
其他	622.54
合计	38,109.05

注:“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 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	300,611.26
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	300,611.26

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	62,817,600.38
减：卖出股票成本总额	62,516,989.12
买卖股票差价收入	300,611.26

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
申购基金份额总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购股票成本总额	-
申购差价收入	-

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	86,568,398.41
减：卖出/赎回基金成本总额	64,264,944.95
基金投资收益	22,303,453.46

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

注：本基金本报告期无债券投资收益。

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

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

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	39,277.41
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	39,277.41

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	-5,800,589.67
——股票投资	-62,533.62
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-5,738,056.05
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-5,800,589.67

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	13,333.89
替代损益	-
其他	-
合计	13,333.89

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	128,142.74
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	2,038.47
其中：申购费	-
赎回费	2,036.69
转换费	-
交易费	1.78
合计	130,181.21

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	3,028.42
指数使用费	-
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	102,207.37

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, 基金注册登记机构
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	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06	上年度可比期间 2020 年 03 月 05 日 (基
-----	--------------------------------	-----------------------------

名称	月 30 日		金合同生效日) 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	64,066,274.38	100.00	1,378,924,988.98	100.00

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 03 月 05 日(基金合同生效日) 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	-	-	439,941.12	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

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 03 月 05 日(基金合同生效日) 至 2020 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	800,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 基金交易

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 03 月 05 日(基金合同生效日) 至 2020 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	39,603.50	100.00	-	-

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 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	59,637.24	100.00	14,062.98	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 03 月 05 日 (基金合同生效日) 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	1,276,921.52	100.00	519,207.11	100.00

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

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 03 月 05 日 (基 金合同生效日) 至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,619.35	504,244.26
其中：支付销售机构的客户维护费	53,339.47	309,428.91

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后余额(若为负数,则取 0)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扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额,若为负数,则 E 取 0

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首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

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03月05日(基金 合同生效日)至2020年 06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,539.74	168,081.43

注：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF份额所对应的资产净值后余额(若为负数,则取0)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扣除所持有目标ETF份额所对应的资产净值后余额(若为负数,则取0),若为负数,则E取0

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首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	添富中证国企一 带一路ETF联接A	添富中证国企一 带一路 ETF联接C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	1,640.24	1,640.24
中国农业银行股份有限公司	-	11,321.75	11,321.75
合计	-	12,961.99	12,961.99
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2020年03月05日(基金合同生效日)至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	添富中证国企一 带一路ETF联接A	添富中证国企一 带一路 ETF联接C	合计
汇添富基金管理	-	466.45	466.45

股份有限公司			
中国农业银行股份有限公司	-	40,112.60	40,112.60
合计	-	40,579.05	40,579.05

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

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

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固定期限费率的证券出借业务。

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

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 03 月 05 日(基金合同生效日) 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	9,419,284.74	37,456.84	62,631,688.12	1,303,003.01

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

于本报告期末，本基金持有 101,966,500.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 23.64%。（于上年度可比期间，本基金持有 1,093,000,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 55.78%。）

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。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
					-	-	-	-	-	
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：单）	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称	日期		受限类型			位： 张)			
113051	节能转债	2021年06月22日	2021年07月22日	新债流通受限	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	

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

注：截至本报告期末 2021 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	9,419,284.74	-	-	-	-	-	9,419,284.74
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	21,987.79	-	-	-	-	-	21,987.79
交易性金融资产	-	-	2,000.00	-	-	136,134,759.52	136,136,759.52
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,748.27	1,748.27
应收申购款	-	-	-	-	-	374,099.99	374,099.99
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	83,540.47	83,540.47
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,441,272.53	-	2,000.00	-	-	136,594,148.25	146,037,420.78
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,502,098.22	2,502,098.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,496.48	1,496.48
应付托管费	-	-	-	-	-	498.80	498.80
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,770.89	3,770.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	14,062.98	14,062.98
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	99,178.95	99,178.95
负债总计	-	-	-	-	-	2,621,106.32	2,621,106.32
利率敏感度缺	9,441,272.53	-	2,000.00	-	-	133,973,041.93	143,416,314.46

口							
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	12,755,287.98	-	-	-	-	-	12,755,287.98
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	293,398.93	-	-	-	-	-	293,398.93
交易性金融资产	-	-	-	-	-	207,984,527.76	207,984,527.76
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	2,765.64	2,765.64
应收申购款	-	-	-	-	-	159,078.47	159,078.47
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,247,126.18	1,247,126.18
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,048,686.91	-	-	-	-	209,393,498.05	222,442,184.96
负债							
应付	-	-	-	-	-	2,726,748.64	2,726,748.64

赎回款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,395.08	2,395.08
应付托管费	-	-	-	-	-	798.36	798.36
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,748.61	4,748.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,847.75	2,847.75
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,887,538.44	2,887,538.44
利率敏感度缺口	13,048,686.91	-	-	-	-	206,505,959.61	219,554,646.52

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的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	3,782,242.52	2.64	5,668,613.26	2.58
交易性金融资产—基金投资	132,352,517.00	92.29	202,315,914.50	92.15
交易性金融资产—债券投资	2,000.00	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	136,136,759.52	94.92	207,984,527.76	94.73

注：本基金投资于目标 ETF 的比例不得低于基金资产净值的 90%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金类资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

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%	-6,573,927.02	-8,395,400.82
	中证国企一带一路指数上涨 5%	6,573,927.02	8,395,400.82

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	3,782,242.52	2.59
	其中：股票	3,782,242.52	2.59
2	基金投资	132,352,517.00	90.63
3	固定收益投资	2,000.00	0.00
	其中：债券	2,000.00	0.00
	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	9,419,284.74	6.45
8	其他资产	481,376.52	0.33

9	合计	146,037,420.78	100.00
---	----	----------------	--------

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	320,454.00	0.22
C	制造业	2,209,331.12	1.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	112,319.80	0.08
E	建筑业	270,609.00	0.19
F	批发和零售业	114,311.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	381,062.40	0.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	171,699.20	0.12
J	金融业	73,006.00	0.05
K	房地产业	39,420.00	0.03
L	租赁和商务服务业	90,030.00	0.06
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	3,782,242.52	2.64

7.2.2 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	5,000	152,700.00	0.11
2	601012	隆基股份	1,400	124,376.00	0.09
3	600309	万华化学	900	97,938.00	0.07
4	601888	中国中免	300	90,030.00	0.06
5	601866	中远海发	21,600	81,000.00	0.06
6	000799	酒鬼酒	300	76,680.00	0.05
7	000100	TCL科技	10,000	76,500.00	0.05

8	600887	伊利股份	2,000	73,660.00	0.05
9	000725	京东方A	11,200	69,888.00	0.05
10	603927	中科软	1,600	68,720.00	0.05
11	002281	光迅科技	2,700	66,420.00	0.05
12	002415	海康威视	1,000	64,500.00	0.04
13	600050	中国联通	14,800	63,936.00	0.04
14	600755	厦门国贸	7,400	60,754.00	0.04
15	000932	华菱钢铁	9,000	59,400.00	0.04
16	000338	潍柴动力	3,300	58,971.00	0.04
17	600188	兖州煤业	3,800	58,368.00	0.04
18	000039	中集集团	3,200	58,176.00	0.04
19	002179	中航光电	700	55,314.00	0.04
20	000625	长安汽车	2,100	55,188.00	0.04
21	688396	华润微	600	54,612.00	0.04
22	600166	福田汽车	15,800	54,510.00	0.04
23	000830	鲁西化工	2,900	54,317.00	0.04
24	000807	云铝股份	4,200	49,980.00	0.03
25	600409	三友化工	4,900	49,539.00	0.03
26	601899	紫金矿业	5,000	48,450.00	0.03
27	000596	古井贡酒	200	47,900.00	0.03
28	002202	金风科技	3,900	47,424.00	0.03
29	600426	华鲁恒升	1,500	46,425.00	0.03
30	601598	中国外运	9,100	45,955.00	0.03
31	600039	四川路桥	7,300	45,771.00	0.03
32	000157	中联重科	4,900	45,276.00	0.03
33	000528	柳工	5,500	45,100.00	0.03
34	002080	中材科技	1,700	44,489.00	0.03
35	600871	石化油服	22,100	43,537.00	0.03
36	002092	中泰化学	3,900	40,053.00	0.03
37	600026	中远海能	6,500	40,040.00	0.03
38	001979	招商蛇口	3,600	39,420.00	0.03
39	000786	北新建材	1,000	39,250.00	0.03
40	601857	中国石油	7,400	39,146.00	0.03
41	600406	国电南瑞	1,680	39,043.20	0.03
42	000661	长春高新	100	38,700.00	0.03
43	600036	招商银行	700	37,933.00	0.03
44	000977	浪潮信息	1,316	37,019.08	0.03
45	002142	宁波银行	900	35,073.00	0.02
46	600028	中国石化	8,000	34,880.00	0.02
47	600600	青岛啤酒	300	34,695.00	0.02
48	600597	光明乳业	2,400	34,584.00	0.02
49	002916	深南电路	300	33,339.00	0.02
50	601390	中国中铁	6,300	33,012.00	0.02

51	000425	徐工机械	5,100	32,487.00	0.02
52	600968	海油发展	12,500	32,375.00	0.02
53	600176	中国巨石	2,057	31,904.07	0.02
54	601985	中国核电	6,200	31,372.00	0.02
55	601088	中国神华	1,600	31,232.00	0.02
56	601618	中国中冶	10,400	30,992.00	0.02
57	600900	长江电力	1,500	30,960.00	0.02
58	000488	晨鸣纸业	3,800	30,932.00	0.02
59	000519	中兵红箭	2,800	30,016.00	0.02
60	601186	中国铁建	4,000	29,720.00	0.02
61	600153	建发股份	3,600	29,160.00	0.02
62	601717	郑煤机	2,500	29,075.00	0.02
63	600008	首创环保	9,580	28,835.80	0.02
64	601668	中国建筑	6,200	28,830.00	0.02
65	002110	三钢闽光	4,100	27,634.00	0.02
66	600299	安迪苏	2,300	27,508.00	0.02
67	000581	威孚高科	1,300	27,079.00	0.02
68	600497	驰宏锌锗	6,200	26,722.00	0.02
69	600362	江西铜业	1,100	24,618.00	0.02
70	600704	物产中大	3,100	24,397.00	0.02
71	600820	隧道股份	4,600	24,334.00	0.02
72	601298	青岛港	3,700	22,866.00	0.02
73	601117	中国化学	2,500	21,900.00	0.02
74	000060	中金岭南	4,800	21,696.00	0.02
75	600104	上汽集团	986	21,662.42	0.02
76	600019	宝钢股份	2,700	20,628.00	0.01
77	600585	海螺水泥	471	19,334.55	0.01
78	601975	招商南油	8,400	17,976.00	0.01
79	601872	招商轮船	3,720	17,186.40	0.01
80	601869	长飞光纤	700	17,052.00	0.01
81	600332	白云山	500	16,925.00	0.01
82	601238	广汽集团	1,300	16,835.00	0.01
83	600563	法拉电子	100	15,836.00	0.01
84	000877	天山股份	1,200	15,636.00	0.01
85	601800	中国交建	2,400	15,552.00	0.01
86	600498	烽火通信	800	14,904.00	0.01
87	600970	中材国际	1,500	13,755.00	0.01
88	601016	节能风电	3,600	13,464.00	0.01
89	600170	上海建工	4,800	13,248.00	0.01
90	601669	中国电建	3,100	11,997.00	0.01
91	600486	扬农化工	100	11,177.00	0.01
92	000738	航发控制	500	10,415.00	0.01
93	601727	上海电气	2,300	9,752.00	0.01

94	600886	国投电力	800	7,688.00	0.01
95	601808	中海油服	400	5,744.00	0.00
96	600018	上港集团	700	3,339.00	0.00
97	600737	中粮糖业	200	2,002.00	0.00
98	600068	葛洲坝	200	1,498.00	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	106,967.00	0.05
2	000100	TCL科技	76,257.00	0.03
3	000799	酒鬼酒	73,700.00	0.03
4	600755	厦门国贸	63,076.00	0.03
5	000807	云铝股份	57,195.00	0.03
6	600166	福田汽车	54,066.00	0.02
7	600409	三友化工	53,115.00	0.02
8	000625	长安汽车	51,684.00	0.02
9	002179	中航光电	51,294.00	0.02
10	600426	华鲁恒升	50,187.00	0.02
11	688396	华润微	47,694.00	0.02
12	000596	古井贡酒	45,743.00	0.02
13	600871	石化油服	44,200.00	0.02
14	601598	中国外运	42,770.00	0.02
15	600436	片仔癀	40,103.00	0.02
16	001979	招商蛇口	39,527.00	0.02
17	600036	招商银行	38,500.00	0.02
18	600597	光明乳业	36,110.00	0.02
19	002142	宁波银行	36,079.00	0.02
20	600887	伊利股份	33,652.00	0.02

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	601888	中国中免	2,201,483.00	1.00
2	601919	中远海控	1,989,797.00	0.91

3	600486	扬农化工	1,860,487.00	0.85
4	600309	万华化学	1,651,682.00	0.75
5	600563	法拉电子	1,473,808.34	0.67
6	603927	中科软	1,372,082.00	0.62
7	601872	招商轮船	1,347,718.00	0.61
8	601975	招商南油	1,262,261.00	0.57
9	601016	节能风电	1,236,901.00	0.56
10	600026	中远海能	1,139,922.38	0.52
11	600039	四川路桥	1,125,970.00	0.51
12	601899	紫金矿业	1,122,539.00	0.51
13	600050	中国联通	1,114,885.00	0.51
14	603712	七一二	1,113,078.00	0.51
15	601866	中远海发	1,094,638.00	0.50
16	600299	安迪苏	1,079,506.90	0.49
17	600887	伊利股份	1,041,870.00	0.47
18	600406	国电南瑞	1,027,592.00	0.47
19	601808	中海油服	979,629.17	0.45
20	600968	海油发展	974,595.00	0.44

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,248,674.00
卖出股票收入（成交）总额	62,817,600.38

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）	2,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,000.00	0.00

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	20	2,000.00	0.00

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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	515990	汇添富中证国企一	交易型开放式	101,966,500.00	132,352,517.00	92.29	是

		带一路交易型开放式指数证券投资基金					
--	--	-------------------	--	--	--	--	--

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

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。

7.13.2

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。

7.13.3 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	21,987.79
2	应收证券清算款	83,540.47
3	应收股利	-
4	应收利息	1,748.27
5	应收申购款	374,099.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	481,376.52

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
添富中证国企一带一路ETF联接 A	4,794	19,307.78	0.00	0.00	92,561,499.93	100.00
添富中证国企一带一路ETF联接 C	2,278	4,782.76	0.00	0.00	10,895,121.38	100.00
合计	7,072	14,629.05	0.00	0.00	103,456,621.31	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	添富中证国企一带一路ETF联接 A	10,220.61	0.01
	添富中证国企一带一路ETF联接 C	0.00	0.00
	合计	10,220.61	0.01

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	添富中证国企一带一路ETF联接 A	0
	添富中证国企一带一路ETF联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	添富中证国企一带一路ETF联接 A	0
	添富中证国企一带一路ETF	0

	联接 C	
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	添富中证国企一带一路ETF联接 A	添富中证国企一带一路ETF联接 C
基金合同生效日（2020年03月05日）基金份额总额	1,725,822,850.32	56,511,957.09
本报告期期初基金份额总额	158,490,693.40	14,974,240.69
本报告期基金总申购份额	26,193,422.35	22,153,019.92
减：本报告期基金总赎回份额	92,122,615.82	26,232,139.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	92,561,499.93	10,895,121.38

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	64,066,274.38	100.00	59,637.24	100.00	
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	-	-	-	-	
国泰君安	2	-	-	-	-	
海通证券	2	-	-	-	-	
恒泰	2	-	-	-	-	

证券							
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	-	-	-	-	-	-	39,603.50	100.00
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	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的提示性公告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021年01月09日
2	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
3	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
4	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
5	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、	上交所,公司网站,深交所	2021年04月02日

	产品资料概要		
6	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
7	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

§ 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

注：无。

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联接基金募集的文件；
- 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联接基金基金合同》；
- 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联接基金托管协议》；
- 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联接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