

汇添富上证综合指数证券投资基金 2019 年 半年度报告

2019 年 6 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 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 2019 年 1 月 1 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	6
§ 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遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	49

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	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富上证综合指数证券投资基金
基金简称	汇添富上证综合指数
基金主代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 7 月 1 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,362,826,579.20 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 6%，以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。
业绩比较基准	上证综合指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率（税后） \times 5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95588
传真	021-28932998	010-66105798
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	李文	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 层

§ 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(2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,751,631.29
本期利润	248,517,498.08
加权平均基金份额本期利润	0.1751
本期加权平均净值利润率	17.66%
本期基金份额净值增长率	19.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	45,662,737.83
期末可供分配基金份额利润	0.0335
期末基金资产净值	1,408,489,317.03
期末基金份额净值	1.034
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	16.82%

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

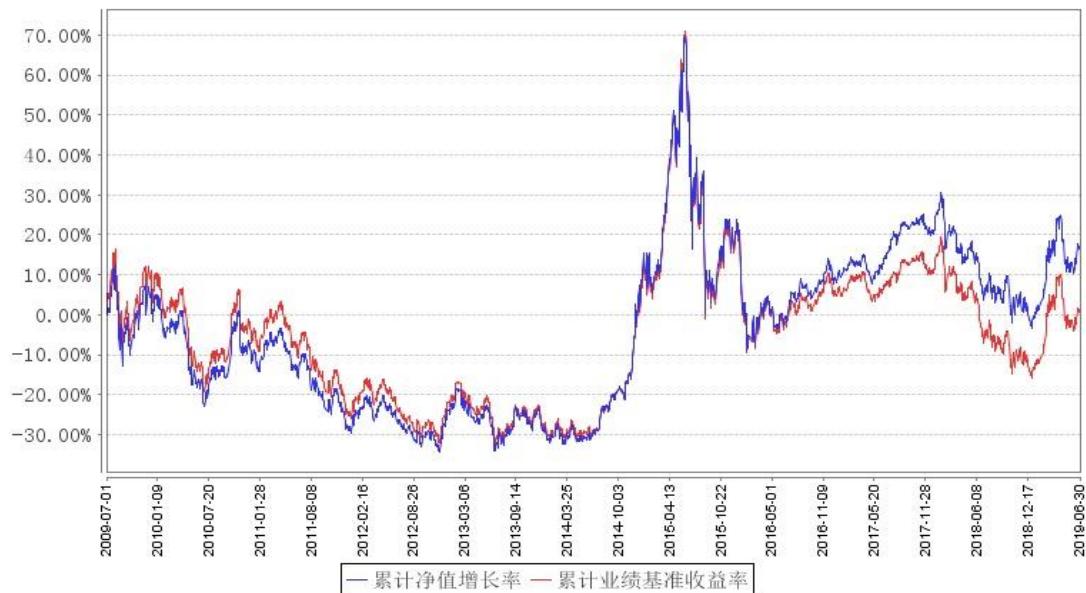
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3. 92%	0. 92%	2. 63%	0. 95%	1. 29%	-0. 03%
过去三个月	-1. 34%	1. 25%	-3. 43%	1. 30%	2. 09%	-0. 05%
过去六个月	19. 26%	1. 30%	18. 48%	1. 34%	0. 78%	-0. 04%
过去一年	8. 96%	1. 28%	4. 40%	1. 32%	4. 56%	-0. 04%
过去三年	16. 08%	0. 93%	1. 65%	0. 96%	14. 43%	-0. 03%
自基金合同生效日起至今	16. 82%	1. 36%	0. 81%	1. 34%	16. 01%	0. 02%

3. 2. 2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富上证综合指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2009 年 7 月 1 日)起 3 个月, 建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 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。

2019上半年，汇添富基金新成立13只公开募集证券投资基金，包括5只债券型基金、4只混合型基金、2只基金中基金、2只指数基金联接基金。截至2019年6月30日，公司共管理133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	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	汇添富上证综合指数、汇添富沪深300安中指数基金、汇添富成长多因子股票基金、汇添富主要消费ETF联接基金、汇添富中证精准医疗指数基金、中证上海证券国企	2010年2月5日	-	13	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格：证券投资基金管理从业资格。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

ETF、汇添富中证互联网医疗指数(LOF)、汇添富中证500指数(LOF)、添富价值多因子股票的基金经理，指数与量化投资部副总监。			数与量化投资部副总监。2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理,2011年9月16日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金的基金经理,2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理,2013年8月23日至2015年11月2日任中证主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金的基金经理,2013年11月6日至今任汇添富沪深300安中指数基金的基金经理,2015年2月16日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理,2015年3月24日至今任汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理,2016年1月21日至今任汇添富中证精准医指基金的基金经理,2016年7月28日至今任中证上海国企ETF的基金经理,2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数(LOF)的基金经理,2017年8月10日至今任汇添富中证500指数(LOF)的基金经理,2018
---	--	--	---

					年 3 月 23 日至今任添富价值多因子股票的基金经理。
--	--	--	--	--	------------------------------

- 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“离职日期”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。

4.2 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严格遵守《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,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合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

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理,涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的交易次数为 5 次,由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

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

2019年上半年，中美贸易摩擦有所反复。在6月底举行的G20大阪峰会上，中美元首会晤并取得了最新的阶段性进展：一是美方表示不再对中国出口产品加征新的关税；二是双方同意在平等和相互尊重的基础上重启经贸磋商。三是特朗普同意美国的公司继续向华为出售零件。

中美贸易摩擦的影响是长期的，对国内的经济增长和产业结构调整都将产生深远的影响。同时，从上半年的实体经济情况来看，房地产投资后续支撑减弱，制造业投资增速有所下滑，专项债对基建投资有所拉动，消费总体保持平稳。二季度经济指标有一定程度的回落，下半年经济下行压力仍较大。因此，今年在宏观调控方面政策仍可能重点实施逆周期调节，通过财政减税降费和货币政策保持流动性合理充裕等对经济形成一定的支撑。

资本市场方面，金融供给侧改革的提出或将加大企业直接融资的比例。科创板的推出定位于符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业，有利于更好的发挥资本市场的资源配置功能。另外，资本市场扩大对外开放，也引入了海外长期资金投资A股。

市场经过二季度的调整以后，估值重新回到了偏低估的状态。报告期末，上证综指指数收盘2978.88点，市盈率13.35，处于历史较低水平，未来存在进一步估值修复的空间。

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

截至本报告期末本基金份额净值为1.034元；本报告期基金份额净值增长率为19.26%，业绩比较基准收益率为18.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年国内经济增速下行压力仍然较大，政策将保持定力，仍会坚持逆周期调节，统筹做好“六稳”工作。总体经济形势或将趋于平稳，出现系统性风险的概率较小。

政策方面，强调继续实施好稳健的货币政策。要坚持实施积极的财政政策，减税降费、专项债、平滑地方隐性债务和基建补短板将是主抓手。对内改革和对外开放并举，以开放促改革。

7月20日，国务院金稳委办公室宣布了11条金融业进一步对外开放的政策措施，涉及债市、保险、理财、券商、基金、期货、信用评级等多个领域，在外资限制放开进程中意义重大，加速A股国际化进程，标志着我国金融对外开放进入了新的阶段。

2019年下半年市场大概率仍将以结构性行情为主。行业上，建议关注受益于政策支持的基建、5G等通信基础设施建设；以及受益于大规模减税降费的必需消费等。

作为被动投资的指数型基金，汇添富上证综合指数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》、《证券投资基金管理核算业务指引》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、基金营运部和稽核监察部人员及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：每年度 6 月和 12 月的最后一个交易日每份基金份额可供分配利润超过 0.02 元时，至少将期末可供分配利润的 20% 进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富上证综合指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利

益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，汇添富上证综合指数证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富上证综合指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富上证综合指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富上证综合指数证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	76,551,101.01	75,897,341.59
结算备付金		356,586.39	—
存出保证金		68,669.29	48,612.21
交易性金融资产	6.4.7.2	1,334,149,383.29	1,263,930,379.16
其中：股票投资		1,334,149,383.29	1,263,773,379.16
基金投资		—	—
债券投资		—	157,000.00
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		—	—
应收利息	6.4.7.5	14,474.38	17,363.24
应收股利		—	—
应收申购款		804,506.27	1,563,426.33

递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 6	-	-
资产总计		1, 411, 944, 720. 63	1, 341, 457, 122. 53
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		-	2, 315, 515. 40
应付赎回款		1, 996, 008. 12	297, 278. 24
应付管理人报酬		858, 844. 62	863, 314. 05
应付托管费		171, 768. 93	172, 662. 79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6. 4. 7. 7	92, 290. 20	33, 295. 38
应交税费		-	3. 73
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 8	336, 491. 73	380, 606. 06
负债合计		3, 455, 403. 60	4, 062, 675. 65
所有者权益:			
实收基金	6. 4. 7. 9	1, 362, 826, 579. 20	1, 543, 394, 010. 35
未分配利润	6. 4. 7. 10	45, 662, 737. 83	-205, 999, 563. 47
所有者权益合计		1, 408, 489, 317. 03	1, 337, 394, 446. 88
负债和所有者权益总计		1, 411, 944, 720. 63	1, 341, 457, 122. 53

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.034 元，基金份额总额 1, 362, 826, 579. 20 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		255, 417, 975. 94	-155, 721, 656. 74
1. 利息收入		293, 732. 50	391, 843. 40
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 11	293, 656. 97	391, 506. 28
债券利息收入		75. 53	337. 12
资产支持证券利息收		-	-

收入			
买入返售金融资产收入			
其他利息收入			
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		9,759,244.24	39,052,326.39
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,825,697.03	20,662,716.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	53,846.36	66,935.06
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	18,531,094.91	18,322,674.62
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	244,765,866.79	-195,460,175.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	599,132.41	294,349.16
减：二、费用		6,900,477.86	8,019,521.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,233,657.50	5,625,849.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,046,731.49	1,125,169.94
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	480,737.33	1,070,887.92
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.25	0.64
7. 其他费用	6.4.7.20	139,351.29	197,613.29
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		248,517,498.08	-163,741,177.99

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 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)	1,543,394,010.35	-205,999,563.47	1,337,394,446.88
二、本期经营活动产生的基金净	-	248,517,498.08	248,517,498.08

值变动数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-180,567,431.15	3,144,803.22	-177,422,627.93
其中: 1. 基金申购款	288,788,402.77	1,826,874.31	290,615,277.08
2. 基金赎回款	-469,355,833.92	1,317,928.91	-468,037,905.01
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)	1,362,826,579.20	45,662,737.83	1,408,489,317.03
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6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)	1,148,960,948.31	102,554,545.44	1,251,515,493.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-163,741,177.99	-163,741,177.99
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)	409,871,914.15	745,969.50	410,617,883.65
其中: 1. 基金申购款	762,169,083.15	25,915,030.82	788,084,113.97
2. 基金赎回款	-352,297,169.00	-25,169,061.32	-377,466,230.32
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)	-	-19,313,624.90	-19,313,624.90
五、期末所有者	1,558,832,862.46	-79,754,287.95	1,479,078,574.51

权益(基金净值)		
----------	--	--

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

汇添富上证综合指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]371 号文《关于核准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的批复》的核准，由汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开发行募集，基金合同于 2009 年 7 月 1 日正式生效，首次设立募集规模为 9,097,758,651.47 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括上海证券交易所上市交易的所有股票、新股（如一级市场初次发行或增发）等。如以后法律法规及中国证监会允许基金投资其他金融工具，如股指期货、ETF 等，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定，将其纳入投资范围。本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。本基金的业绩比较基准为：上证综合指数收益率×95%+银行活期存款利率（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（以下统称“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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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<年度报告和半年度报告>》、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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年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、地方政府债券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
	2019 年 6 月 30 日
活期存款	76,551,101.01
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	76,551,101.01

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2019 年 6 月 30 日	成本	公允价值
股票	1,308,456,073.21	1,334,149,383.29	25,693,310.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,308,456,073.21	1,334,149,383.29	25,693,310.08

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:本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

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 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	14,302.12
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	144.45
应收债券利息	—
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	—
其他	27.81
合计	14,474.38

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 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	92,290.20
银行间市场应付交易费用	—
合计	92,290.20

6.4.7.8 其他负债

单位: 人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	6,288.44
应付信息披露费	290,531.71

应付审计费	39,671.58
合计	336,491.73

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,543,394,010.35	1,543,394,010.35
本期申购	288,788,402.77	288,788,402.77
本期赎回(以“-”号填列)	-469,355,833.92	-469,355,833.92
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,362,826,579.20	1,362,826,579.20

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	512,898,693.13	-718,898,256.60	-205,999,563.47
本期利润	3,751,631.29	244,765,866.79	248,517,498.08
本期基金份额交易产生的变动数	-59,303,018.73	62,447,821.95	3,144,803.22
其中：基金申购款	94,011,522.59	-92,184,648.28	1,826,874.31
基金赎回款	-153,314,541.32	154,632,470.23	1,317,928.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	457,347,305.69	-411,684,567.86	45,662,737.83

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入		290,199.99
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		1,028.05
其他		2,428.93
合计		293,656.97

注：表中“其他”指直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	215,540,660.23
减：卖出股票成本总额	224,366,357.26
买卖股票差价收入	-8,825,697.03

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	407,933.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	354,000.00
减：应收利息总额	87.44
买卖债券差价收入	53,846.36

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	18,531,094.91
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,531,094.91

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	244,765,866.79
股票投资	244,765,866.79
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-

权证投资	-
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	244,765,866.79

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	599,132.41
合计	599,132.41

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	480,737.33
银行间市场交易费用	-
合计	480,737.33

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	90,531.71
账户维护费	9,000.00
银行费用	148.00
合计	139,351.29

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银	基金托管人、基金代销机构

行”)	
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

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日	成交金额	2018年1月1日至2018年6月30日	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	261,367,788.28	100.00	532,154,870.43	64.94

6.4.10.1.2 债券交易

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日	成交金额	2018年1月1日至2018年6月30日	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	407,933.80	100.00	922,251.70	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

关联方名称	本期			
	2019年1月1日至2019年6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 (%)	

东方证券股份有限公司	243,414.01	100.00	92,290.20	100.00
上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日				
关联方名称	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 (%)
东方证券股份有限公司	495,598.92	64.94	991.12	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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,233,657.50	5,625,849.46
其中:支付销售机构的客户维护费	935,150.53	883,642.46

注:本基金的管理费按前一日资产净值 0.75%年费率计提。管理费计算方法如下:

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

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,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 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。如遇法定节假日,公休假等,支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,046,731.49	1,125,169.94

注:基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。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，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 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、公休日等，支付日期顺延。

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:本基金与关联方本期和上年度可比期间未通过银行间同业市场进行债券(回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	76,551,101.01	290,199.99	115,651,524.18	365,473.52

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位: 人民币元

注:本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

注:本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2019 年 6 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
600480	凌云	2019 年	2019 年	配股流	8.74	8.75	23,430	204,778.20	205,012.50	-

	股份	6月20日	7月3日	通受限						
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600510	黑牡丹	2019年6月19日	重大资产重组停牌	6.32	2019年07月03日	6.95	194,981	1,577,593.99	1,232,279.92	-
600485	*ST信威	2017年04月27日	重大资产重组停牌	5.76	2019年07月12日	13.86	101,219	3,187,718.99	583,021.40	-

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

截至本报告期末 2019 年 6 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金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 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金融资产款余额。

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。

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，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。本基金的生息资产主要为银行存款、债券投资、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期 末 2019 年 6 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	76,551,101.01	-	-	-	-	-	76,551,101.01
结算备付金	356,586.39	-	-	-	-	-	356,586.39
存出保证金	68,669.29	-	-	-	-	-	68,669.29
交易性金融资产						1,334,149,383.29	1,334,149,383.29
应收利息		-	-	-	-	14,474.38	14,474.38
应收申购款	114,879.85	-	-	-	-	689,626.42	804,506.27
资产总计	77,091,236.54	-	-	-	-	1,334,853,484.09	1,411,944,720.63
负债							
应付赎回款		-	-	-	-	1,996,008.12	1,996,008.12
应付管理人报酬		-	-	-	-	858,844.62	858,844.62
应付	-	-	-	-	-	171,768.93	171,768.93

托管费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	92,290.20	92,290.20
其他负债	-	-	-	-	-	336,491.73	336,491.73
负债总计	-	-	-	-	-	3,455,403.60	3,455,403.60
利率敏感度缺口	77,091,236 .54	-	-	-	-	1,331,398,01 80.49	1,408,489,31 7.03
上年度末 2018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	75,897,341 .59	-	-	-	-	-	75,897,341.5 9
存出保证金	48,612.21	-	-	-	-	-	48,612.21
交易性金融资产	-	-	157,000.00	-	-	1,263,773,31 79.16	1,263,930,37 9.16
应收利息	-	-	-	-	-	17,363.24	17,363.24
应收申购款	282,359.18	-	-	-	-	1,281,067.1 5	1,563,426.33
资产总计	76,228,312 .98	-	157,000.00	-	-	1,265,071,81 09.55	1,341,457,12 2.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	297,278.24	297,278.24

应付管理人报酬					863,314.05	863,314.05
应付托管费					172,662.79	172,662.79
应付证券清算款					2,315,515.40	2,315,515.40
应付交易费用					33,295.38	33,295.38
应付税费					3.73	3.73
其他负债					380,606.06	380,606.06
负债总计					4,062,675.65	4,062,675.65
利率敏感度缺口	76,228,312.98		157,000.00		1,261,009,133.90	1,337,394,446.88

注:上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，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:本基金本报告期末及上年度末计息资产仅包括银行存款、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。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的主要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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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	1,334,149,383.29	94.72	1,263,773,379.16	94.50
交易性金融资产 —基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产 —债券投资	—	—	157,000.00	0.01
交易性金融资产 —贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产 —权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,334,149,383.29	94.72	1,263,930,379.16	94.51

注：本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 90%–95%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；投资于标的指数成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%。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表。

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。		
	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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	上证综合指数上涨 5%	64,654,194.16	61,419,849.85

	上证综合指数下跌 5%	-64,654,194.16	-61,419,849.85
--	----------------	----------------	----------------

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

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,334,149,383.29	94.49
	其中:股票	1,334,149,383.29	94.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	76,907,687.40	5.45
8	其他各项资产	887,649.94	0.06
9	合计	1,411,944,720.63	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	2,786,476.80	0.2
B	采矿业	130,723,784.80	9.28
C	制造业	426,717,005.72	30.3
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,599,370.59	4.16
E	建筑业	45,742,138.24	3.25
F	批发和零售业	37,702,600.14	2.68

G	交通运输、仓储和邮电业	66,609,379.71	4.73
H	住宿和餐饮业	3,230,942.26	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,231,723.84	1.86
J	金融业	450,554,069.99	31.99
K	房地产业	48,904,183.93	3.47
L	租赁和商务服务业	11,822,760.49	0.84
M	科学研究和技术服务业	2,267,319.30	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	2,224,522.54	0.16
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	13,123,989.86	0.93
S	综合	6,732,196.81	0.48
	合计	1,333,972,465.02	94.71

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	103,444.57	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮电业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.00
J	金融业	33,869.94	0.00
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和	—	—

	其他服务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	176,918.27	0.01

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股票投资。

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

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	601288	农业银行	17,237,673	62,055,622.80	4.41
2	600519	贵州茅台	59,362	58,412,208.00	4.15
3	600036	招商银行	1,518,215	54,625,375.70	3.88
4	601857	中国石油	7,315,257	50,328,968.16	3.57
5	601988	中国银行	13,135,811	49,127,933.14	3.49
6	601318	中国平安	490,803	43,490,053.83	3.09
7	601628	中国人寿	946,471	26,804,058.72	1.90
8	601328	交通银行	4,128,917	25,268,972.04	1.79
9	600028	中国石化	4,322,077	23,641,761.19	1.68
10	601939	建设银行	2,559,911	19,045,737.84	1.35
11	600900	长江电力	994,111	17,794,586.90	1.26
12	601166	兴业银行	944,506	17,275,014.74	1.23
13	601088	中国神华	749,215	15,269,001.70	1.08
14	600000	浦发银行	1,275,092	14,893,074.56	1.06
15	600104	上汽集团	530,799	13,535,374.50	0.96
16	600276	恒瑞医药	204,169	13,475,154.00	0.96
17	603288	海天味业	126,575	13,290,375.00	0.94
18	601668	中国建筑	1,921,085	11,046,238.75	0.78
19	601601	中国太保	293,178	10,703,928.78	0.76
20	600030	中信证券	439,600	10,466,876.00	0.74
21	600016	民生银行	1,622,708	10,304,195.80	0.73
22	601688	华泰证券	427,460	9,540,907.20	0.68
23	600887	伊利股份	281,161	9,393,589.01	0.67
24	601998	中信银行	1,568,472	9,363,777.84	0.66
25	601225	陕西煤业	1,007,081	9,305,428.44	0.66
26	601766	中国中车	1,115,661	9,025,697.49	0.64
27	601888	中国国旅	94,405	8,369,003.25	0.59

28	600009	上海机场	93,965	7,872,387.70	0.56
29	600585	海螺水泥	185,381	7,693,311.50	0.55
30	600031	三一重工	560,194	7,327,337.52	0.52
31	600018	上港集团	1,066,590	7,274,143.80	0.52
32	600050	中国联通	1,150,242	7,085,490.72	0.50
33	600048	保利地产	548,269	6,995,912.44	0.50
34	601818	光大银行	1,826,967	6,960,744.27	0.49
35	600019	宝钢股份	1,017,055	6,610,857.50	0.47
36	601211	国泰君安	345,800	6,345,430.00	0.45
37	601800	中国交建	542,239	6,138,145.48	0.44
38	601229	上海银行	502,005	5,948,759.25	0.42
39	601006	大秦铁路	682,144	5,518,544.96	0.39
40	601390	中国中铁	845,728	5,514,146.56	0.39
41	601336	新华保险	98,855	5,439,990.65	0.39
42	601989	中国重工	972,529	5,407,261.24	0.38
43	600837	海通证券	373,186	5,295,509.34	0.38
44	601186	中国铁建	529,559	5,269,112.05	0.37
45	600690	青岛海尔	292,000	5,048,680.00	0.36
46	601169	北京银行	838,372	4,954,778.52	0.35
47	600015	华夏银行	589,981	4,542,853.70	0.32
48	600340	华夏幸福	138,436	4,508,860.52	0.32
49	600999	招商证券	263,097	4,496,327.73	0.32
50	601933	永辉超市	437,017	4,461,943.57	0.32
51	601111	中国国航	461,081	4,412,545.17	0.31
52	601155	新城控股	110,599	4,402,946.19	0.31
53	601012	隆基股份	179,763	4,154,322.93	0.29
54	600309	万华化学	96,511	4,129,705.69	0.29
55	600188	兖州煤业	378,383	4,113,023.21	0.29
56	601985	中国核电	715,400	3,977,624.00	0.28
57	601117	中国化学	660,527	3,976,372.54	0.28
58	600183	生益科技	261,553	3,936,372.65	0.28
59	600919	江苏银行	532,600	3,866,676.00	0.27
60	600606	绿地控股	561,588	3,835,646.04	0.27
61	600271	XD 航天信	163,224	3,762,313.20	0.27
62	601669	中国电建	705,183	3,730,418.07	0.26
63	600436	片仔癀	32,237	3,713,702.40	0.26
64	601881	中国银河	298,704	3,659,124.00	0.26
65	600547	山东黄金	86,119	3,545,519.23	0.25
66	601100	恒立液压	112,235	3,521,934.30	0.25
67	600010	包钢股份	2,081,880	3,518,377.20	0.25
68	600161	天坛生物	137,369	3,468,567.25	0.25
69	601238	广汽集团	315,156	3,444,655.08	0.24

70	600089	特变电工	473,819	3,435,187.75	0.24
71	600153	建发股份	383,595	3,406,323.60	0.24
72	600516	方大炭素	276,250	3,395,112.50	0.24
73	603160	汇顶科技	24,104	3,345,635.20	0.24
74	600588	用友网络	122,693	3,297,987.84	0.23
75	600809	山西汾酒	46,526	3,212,620.30	0.23
76	601009	南京银行	388,676	3,210,463.76	0.23
77	603993	洛阳钼业	808,039	3,199,834.44	0.23
78	600741	华域汽车	147,250	3,180,600.00	0.23
79	600529	山东药玻	137,625	3,135,097.50	0.22
80	600332	白云山	75,677	3,100,486.69	0.22
81	603338	浙江鼎力	51,381	3,016,578.51	0.21
82	600011	华能国际	483,496	3,012,180.08	0.21
83	601899	紫金矿业	793,142	2,990,145.34	0.21
84	600115	东方航空	453,326	2,842,354.02	0.20
85	600023	浙能电力	625,579	2,765,059.18	0.20
86	600549	厦门钨业	192,601	2,756,120.31	0.20
87	600570	恒生电子	40,199	2,739,561.85	0.19
88	601901	方正证券	378,300	2,689,713.00	0.19
89	600438	通威股份	191,285	2,689,467.10	0.19
90	601018	宁波港	605,474	2,658,030.86	0.19
91	600383	金地集团	219,400	2,617,442.00	0.19
92	601727	上海电气	477,092	2,566,754.96	0.18
93	601231	环旭电子	209,978	2,530,234.90	0.18
94	600029	南方航空	323,441	2,496,964.52	0.18
95	600886	国投电力	320,405	2,489,546.85	0.18
96	601618	中国中冶	818,359	2,487,811.36	0.18
97	600352	浙江龙盛	156,922	2,474,659.94	0.18
98	601633	长城汽车	293,125	2,424,143.75	0.17
99	601877	正泰电器	104,862	2,421,263.58	0.17
100	600196	复星医药	94,691	2,395,682.30	0.17
101	600061	国投资本	169,803	2,378,940.03	0.17
102	600705	中航资本	433,756	2,350,957.52	0.17
103	600967	内蒙一机	209,480	2,346,176.00	0.17
104	600346	恒力股份	192,389	2,339,450.24	0.17
105	600218	全柴动力	159,000	2,289,600.00	0.16
106	603833	欧派家居	21,115	2,272,396.30	0.16
107	601098	中南传媒	179,256	2,265,795.84	0.16
108	600795	国电电力	889,028	2,258,131.12	0.16
109	600111	北方稀土	175,587	2,254,537.08	0.16
110	600350	山东高速	467,037	2,241,777.60	0.16
111	600660	福耀玻璃	97,830	2,223,675.90	0.16

112	600663	陆家嘴	142,902	2,214,981.00	0.16
113	600406	国电南瑞	118,702	2,212,605.28	0.16
114	600810	神马股份	175,264	2,164,510.40	0.15
115	600893	航发动力	94,752	2,151,817.92	0.15
116	600703	三安光电	190,662	2,150,667.36	0.15
117	600593	大连圣亚	57,320	2,148,926.80	0.15
118	603508	思维列控	32,204	2,095,836.32	0.15
119	601788	光大证券	181,238	2,069,737.96	0.15
120	600926	杭州银行	247,780	2,064,007.40	0.15
121	600745	闻泰科技	61,900	2,056,318.00	0.15
122	601377	兴业证券	305,006	2,055,740.44	0.15
123	600201	生物股份	129,446	2,031,007.74	0.14
124	601866	中远海发	737,992	2,007,338.24	0.14
125	601898	中煤能源	416,687	2,000,097.60	0.14
126	600511	国药股份	87,020	1,998,849.40	0.14
127	600098	广州发展	322,157	1,984,487.12	0.14
128	600085	同仁堂	68,182	1,977,278.00	0.14
129	600482	中国动力	83,600	1,974,632.00	0.14
130	600398	海澜之家	216,795	1,966,330.65	0.14
131	600377	宁沪高速	182,910	1,964,453.40	0.14
132	600323	瀚蓝环境	114,692	1,936,000.96	0.14
133	600649	城投控股	287,225	1,858,345.75	0.13
134	603606	东方电缆	212,682	1,843,952.94	0.13
135	601021	春秋航空	40,703	1,831,635.00	0.13
136	601919	中远海控	363,329	1,823,911.58	0.13
137	600600	青岛啤酒	36,451	1,819,998.43	0.13
138	600688	上海石化	351,894	1,815,773.04	0.13
139	600637	东方明珠	171,669	1,809,391.26	0.13
140	600674	川投能源	202,000	1,797,800.00	0.13
141	600004	白云机场	97,705	1,778,231.00	0.13
142	603589	口子窖	27,176	1,750,677.92	0.12
143	600612	老凤祥	38,804	1,734,538.80	0.12
144	600064	南京高科	161,940	1,734,377.40	0.12
145	600489	中金黄金	167,643	1,721,693.61	0.12
146	601607	上海医药	94,395	1,713,269.25	0.12
147	600390	五矿资本	181,100	1,707,773.00	0.12
148	600236	桂冠电力	280,198	1,697,999.88	0.12
149	600260	凯乐科技	84,900	1,696,302.00	0.12
150	601600	中国铝业	420,965	1,650,182.80	0.12
151	600176	中国巨石	171,526	1,634,642.78	0.12
152	600297	广汇汽车	361,801	1,613,632.46	0.11
153	600362	江西铜业	102,432	1,612,279.68	0.11

154	600848	上海临港	51,740	1,610,666.20	0.11
155	600233	圆通速递	130,500	1,609,065.00	0.11
156	600487	亨通光电	95,179	1,595,200.04	0.11
157	601198	东兴证券	133,998	1,591,896.24	0.11
158	600170	上海建工	422,551	1,588,791.76	0.11
159	600895	张江高科	76,809	1,576,120.68	0.11
160	600282	南钢股份	449,400	1,572,900.00	0.11
161	601678	滨化股份	232,514	1,571,794.64	0.11
162	600708	光明地产	281,069	1,568,365.02	0.11
163	600410	华胜天成	143,400	1,538,682.00	0.11
164	600177	雅戈尔	241,991	1,536,642.85	0.11
165	601212	白银有色	348,100	1,528,159.00	0.11
166	600559	老白干酒	116,544	1,525,560.96	0.11
167	600461	洪城水业	241,800	1,523,340.00	0.11
168	601992	金隅集团	400,562	1,506,113.12	0.11
169	601555	东吴证券	146,892	1,505,643.00	0.11
170	600368	五洲交通	321,660	1,505,368.80	0.11
171	600850	华东电脑	70,400	1,498,816.00	0.11
172	600867	通化东宝	97,047	1,494,523.80	0.11
173	601991	大唐发电	481,841	1,488,888.69	0.11
174	600088	中视传媒	109,172	1,483,647.48	0.11
175	600020	中原高速	281,101	1,475,780.25	0.10
176	600027	华电国际	390,875	1,473,598.75	0.10
177	600273	嘉化能源	127,000	1,468,120.00	0.10
178	600498	烽火通信	52,648	1,466,773.28	0.10
179	600675	DR 中华企	281,995	1,463,554.05	0.10
180	601878	浙商证券	155,598	1,447,061.40	0.10
181	601177	杭齿前进	154,380	1,431,102.60	0.10
182	600977	中国电影	91,000	1,425,060.00	0.10
183	600109	国金证券	146,370	1,422,716.40	0.10
184	600862	中航高科	157,397	1,414,999.03	0.10
185	600068	葛洲坝	223,519	1,392,523.37	0.10
186	601808	中海油服	144,197	1,388,617.11	0.10
187	600073	上海梅林	149,800	1,378,160.00	0.10
188	601997	贵阳银行	158,600	1,371,890.00	0.10
189	600448	华纺股份	233,300	1,364,805.00	0.10
190	600641	万业企业	114,500	1,353,390.00	0.10
191	600118	中国卫星	60,006	1,353,135.30	0.10
192	601007	金陵饭店	121,800	1,348,326.00	0.10
193	600168	武汉控股	185,600	1,347,456.00	0.10
194	600597	光明乳业	125,296	1,346,932.00	0.10
195	600299	安迪苏	129,800	1,346,026.00	0.10

196	600633	浙数文化	143,896	1,345,427.60	0.10
197	600369	西南证券	271,678	1,342,089.32	0.10
198	600452	涪陵电力	75,871	1,339,881.86	0.10
199	600816	安信信托	264,102	1,333,715.10	0.09
200	600066	宇通客车	102,399	1,333,234.98	0.09
201	600835	上海机电	80,263	1,332,365.80	0.09
202	600522	中天科技	144,473	1,324,817.41	0.09
203	600839	四川长虹	447,793	1,320,989.35	0.09
204	600127	金健米业	264,800	1,318,704.00	0.09
205	600642	申能股份	218,080	1,310,660.80	0.09
206	600219	南山铝业	574,549	1,298,480.74	0.09
207	600208	新湖中宝	413,010	1,296,851.40	0.09
208	603018	中设集团	103,956	1,294,252.20	0.09
209	600757	XD 长江传	189,907	1,293,266.67	0.09
210	600535	天士力	78,130	1,293,051.50	0.09
211	600345	长江通信	46,700	1,289,387.00	0.09
212	600038	中直股份	31,406	1,288,274.12	0.09
213	600729	重庆百货	42,476	1,284,474.24	0.09
214	600372	中航电子	84,909	1,260,049.56	0.09
215	603167	渤海轮渡	127,304	1,256,490.48	0.09
216	601228	广州港	300,475	1,255,985.50	0.09
217	600528	中铁工业	108,308	1,253,123.56	0.09
218	603599	广信股份	85,200	1,249,884.00	0.09
219	600566	济川药业	41,300	1,243,543.00	0.09
220	601811	新华文轩	101,600	1,240,536.00	0.09
221	600167	联美控股	117,170	1,239,658.60	0.09
222	600731	湖南海利	172,700	1,234,805.00	0.09
223	600510	黑牡丹	194,981	1,232,279.92	0.09
224	601158	重庆水务	219,464	1,228,998.40	0.09
225	601107	四川成渝	303,225	1,228,061.25	0.09
226	600665	XD 天地源	312,193	1,226,918.49	0.09
227	601137	博威合金	124,100	1,219,903.00	0.09
228	600987	航民股份	183,635	1,213,827.35	0.09
229	603799	华友钴业	56,913	1,212,816.03	0.09
230	600479	千金药业	129,740	1,209,176.80	0.09
231	600455	博通股份	43,007	1,205,486.21	0.09
232	603663	三祥新材	86,400	1,205,280.00	0.09
233	600583	海油工程	213,220	1,194,032.00	0.08
234	603393	新天然气	50,921	1,191,551.40	0.08
235	600873	梅花生物	247,531	1,185,673.49	0.08
236	601699	潞安环能	148,205	1,176,747.70	0.08
237	600853	龙建股份	243,870	1,168,137.30	0.08

238	600287	江苏舜天	176,600	1,165,560.00	0.08
239	600057	厦门象屿	261,783	1,164,934.35	0.08
240	600229	城市传媒	155,000	1,164,050.00	0.08
241	601099	太平洋	326,637	1,162,827.72	0.08
242	600694	大商股份	41,624	1,161,725.84	0.08
243	601900	南方传媒	121,997	1,158,971.50	0.08
244	600256	广汇能源	325,546	1,158,943.76	0.08
245	601677	明泰铝业	112,398	1,158,823.38	0.08
246	600909	华安证券	176,900	1,156,926.00	0.08
247	600062	华润双鹤	91,733	1,156,753.13	0.08
248	600155	华创阳安	86,100	1,156,323.00	0.08
249	603077	和邦生物	605,815	1,151,048.50	0.08
250	600351	亚宝药业	185,891	1,143,229.65	0.08
251	601598	中国外运	238,065	1,140,331.35	0.08
252	603100	川仪股份	123,678	1,136,600.82	0.08
253	600811	东方集团	304,952	1,134,421.44	0.08
254	600488	天药股份	265,700	1,131,882.00	0.08
255	600339	中油工程	267,889	1,130,491.58	0.08
256	600573	惠泉啤酒	144,900	1,127,322.00	0.08
257	600750	江中药业	86,603	1,126,705.03	0.08
258	600704	物产中大	207,492	1,124,606.64	0.08
259	600393	粤泰股份	241,790	1,124,323.50	0.08
260	600376	首开股份	125,541	1,121,081.13	0.08
261	601636	旗滨集团	287,300	1,117,597.00	0.08
262	600315	上海家化	35,701	1,112,086.15	0.08
263	600221	海航控股	547,460	1,111,343.80	0.08
264	601339	百隆东方	244,600	1,108,038.00	0.08
265	600497	驰宏锌锗	216,785	1,101,267.80	0.08
266	600790	轻纺城	302,780	1,099,091.40	0.08
267	600375	华菱星马	211,700	1,098,723.00	0.08
268	603919	金徽酒	71,302	1,097,337.78	0.08
269	603515	欧普照明	34,003	1,096,596.75	0.08
270	603989	艾华集团	58,061	1,096,191.68	0.08
271	600739	辽宁成大	75,348	1,095,559.92	0.08
272	600336	XD 澳柯玛	245,482	1,089,940.08	0.08
273	603118	共进股份	117,600	1,088,976.00	0.08
274	600640	号百控股	80,900	1,082,442.00	0.08
275	601872	招商轮船	247,208	1,077,826.88	0.08
276	600325	华发股份	137,762	1,075,921.22	0.08
277	600356	恒丰纸业	147,304	1,075,319.20	0.08
278	603025	大豪科技	104,760	1,072,742.40	0.08
279	601518	吉林高速	372,456	1,072,673.28	0.08

280	600283	钱江水利	96,600	1,072,260.00	0.08
281	601579	会稽山	121,300	1,071,079.00	0.08
282	603869	新智认知	58,500	1,064,700.00	0.08
283	600984	建设机械	161,680	1,059,004.00	0.08
284	600819	耀皮玻璃	208,900	1,057,034.00	0.08
285	600668	尖峰集团	81,800	1,047,040.00	0.07
286	603979	金诚信	124,200	1,045,764.00	0.07
287	600875	东方电气	98,299	1,043,935.38	0.07
288	600578	京能电力	321,911	1,042,991.64	0.07
289	603779	威龙股份	74,602	1,040,697.90	0.07
290	600279	重庆港九	222,300	1,040,364.00	0.07
291	601188	龙江交通	308,600	1,039,982.00	0.07
292	601958	金钼股份	154,635	1,036,054.50	0.07
293	600415	小商品城	251,173	1,034,832.76	0.07
294	600210	紫江企业	254,737	1,031,684.85	0.07
295	600128	弘业股份	133,805	1,031,636.55	0.07
296	600106	重庆路桥	321,088	1,030,692.48	0.07
297	600378	天科股份	66,741	1,027,811.40	0.07
298	600361	华联综超	249,189	1,026,658.68	0.07
299	600400	红豆股份	280,960	1,025,504.00	0.07
300	600203	福日电子	168,600	1,023,402.00	0.07
301	600982	宁波热电	300,800	1,022,720.00	0.07
302	600971	恒源煤电	174,346	1,019,924.10	0.07
303	600699	均胜电子	47,700	1,018,872.00	0.07
304	601216	君正集团	308,050	1,013,484.50	0.07
305	600603	广汇物流	224,040	1,012,660.80	0.07
306	600331	宏达股份	315,427	1,012,520.67	0.07
307	600823	世茂股份	219,580	1,012,263.80	0.07
308	600382	广东明珠	131,410	1,010,542.90	0.07
309	601966	玲珑轮胎	59,300	1,008,100.00	0.07
310	600327	大东方	265,919	1,007,833.01	0.07
311	600561	江西长运	154,100	1,007,814.00	0.07
312	600312	平高电气	130,973	1,007,182.37	0.07
313	601928	凤凰传媒	124,385	1,003,786.95	0.07
314	600268	国电南自	168,929	1,003,438.26	0.07
315	600697	欧亚集团	53,300	1,002,040.00	0.07
316	600998	九州通	80,983	1,000,949.88	0.07
317	600658	电子城	195,564	999,332.04	0.07
318	601199	江南水务	253,594	996,624.42	0.07
319	601611	中国核建	127,200	989,616.00	0.07
320	600577	精达股份	326,360	988,870.80	0.07
321	603726	朗迪集团	82,435	987,571.30	0.07

322	600300	维维股份	294,690	987,211.50	0.07
323	600808	马钢股份	288,830	984,910.30	0.07
324	600894	广日股份	125,599	983,440.17	0.07
325	600392	盛和资源	88,694	980,955.64	0.07
326	600502	安徽水利	210,840	980,406.00	0.07
327	600628	新世界	134,385	975,635.10	0.07
328	601118	海南橡胶	189,387	975,343.05	0.07
329	601218	吉鑫科技	324,672	974,016.00	0.07
330	603698	航天工程	78,158	973,067.10	0.07
331	603008	喜临门	88,200	972,846.00	0.07
332	600409	三友化工	171,726	971,969.16	0.07
333	600618	氯碱化工	123,500	970,710.00	0.07
334	600308	华泰股份	216,925	967,485.50	0.07
335	603159	DR 上海亚	67,642	965,927.76	0.07
336	600589	广东榕泰	198,300	965,721.00	0.07
337	600754	锦江股份	39,173	965,222.72	0.07
338	600449	宁夏建材	113,600	963,328.00	0.07
339	600557	康缘药业	64,775	962,556.50	0.07
340	600676	交运股份	188,500	950,040.00	0.07
341	600586	金晶科技	293,898	949,290.54	0.07
342	600885	宏发股份	38,981	947,238.30	0.07
343	600100	同方股份	104,522	945,924.10	0.07
344	600160	巨化股份	132,729	943,703.19	0.07
345	601126	四方股份	157,800	943,644.00	0.07
346	600973	宝胜股份	243,300	936,705.00	0.07
347	600598	北大荒	87,295	936,675.35	0.07
348	600713	南京医药	205,296	932,043.84	0.07
349	600976	健民集团	56,402	930,068.98	0.07
350	601608	中信重工	214,085	924,847.20	0.07
351	600820	隧道股份	146,290	923,089.90	0.07
352	600099	林海股份	121,900	922,783.00	0.07
353	600021	上海电力	105,966	919,784.88	0.07
354	600258	首旅酒店	51,023	917,393.54	0.07
355	600796	钱江生化	165,382	911,254.82	0.06
356	601179	中国西电	245,419	908,050.30	0.06
357	600521	华海药业	63,800	899,580.00	0.06
358	600858	银座股份	173,800	888,118.00	0.06
359	601127	小康股份	67,700	886,870.00	0.06
360	600480	凌云股份	100,931	883,146.25	0.06
361	601333	广深铁路	272,451	880,016.73	0.06
362	600180	瑞茂通	111,796	879,834.52	0.06
363	603898	好莱客	53,002	876,653.08	0.06

364	603816	顾家家居	27,419	875,214.48	0.06
365	600975	新五丰	79,280	874,458.40	0.06
366	603090	宏盛股份	58,100	868,014.00	0.06
367	600475	华光股份	79,700	867,136.00	0.06
368	600317	营口港	313,374	864,912.24	0.06
369	600966	博汇纸业	226,477	862,877.37	0.06
370	600022	山东钢铁	515,718	861,249.06	0.06
371	600584	长电科技	66,371	852,867.35	0.06
372	600758	红阳能源	164,000	851,160.00	0.06
373	603306	华懋科技	64,405	850,790.05	0.06
374	603020	爱普股份	104,100	850,497.00	0.06
375	600338	西藏珠峰	48,563	848,881.24	0.06
376	600373	中文传媒	67,562	848,578.72	0.06
377	600854	春兰股份	215,600	842,996.00	0.06
378	600527	江南高纤	382,204	840,848.80	0.06
379	601128	常熟银行	108,905	840,746.60	0.06
380	601616	广电电气	236,034	840,281.04	0.06
381	600664	哈药股份	202,656	838,995.84	0.06
382	603001	奥康国际	82,400	835,536.00	0.06
383	600333	长春燃气	155,809	835,136.24	0.06
384	601718	际华集团	213,078	833,134.98	0.06
385	600067	冠城大通	176,532	831,465.72	0.06
386	600008	首创股份	235,800	830,016.00	0.06
387	600348	阳泉煤业	142,707	829,127.67	0.06
388	601599	鹿港文化	260,423	817,728.22	0.06
389	600864	哈投股份	104,700	816,660.00	0.06
390	600879	航天电子	132,300	814,968.00	0.06
391	600718	东软集团	63,192	810,121.44	0.06
392	600243	青海华鼎	169,800	808,248.00	0.06
393	603225	新凤鸣	64,107	800,696.43	0.06
394	600114	东睦股份	127,088	799,383.52	0.06
395	601880	大连港	375,160	799,090.80	0.06
396	600784	鲁银投资	154,700	798,252.00	0.06
397	601000	唐山港	289,100	795,025.00	0.06
398	600827	百联股份	80,985	794,462.85	0.06
399	600673	东阳光	101,152	794,043.20	0.06
400	600080	金花股份	120,694	789,338.76	0.06
401	600468	百利电气	173,512	780,804.00	0.06
402	600500	中化国际	103,590	773,817.30	0.05
403	600007	XD 中国国	52,959	772,671.81	0.05
404	600742	XD 一汽富	72,394	772,443.98	0.05
405	600090	同济堂	164,590	770,281.20	0.05

406	600126	杭钢股份	167,650	764,484.00	0.05
407	600266	北京城建	93,875	756,632.50	0.05
408	603766	隆鑫通用	177,992	745,786.48	0.05
409	600567	山鹰纸业	220,700	743,759.00	0.05
410	600655	豫园股份	90,541	741,530.79	0.05
411	601168	西部矿业	116,169	741,158.22	0.05
412	600889	南京化纤	143,800	739,132.00	0.05
413	603798	康普顿	63,400	736,708.00	0.05
414	603818	曲美家居	96,096	730,329.60	0.05
415	600761	XD 安徽合	75,803	727,708.80	0.05
416	600056	中国医药	53,704	724,466.96	0.05
417	603788	宁波高发	53,224	722,781.92	0.05
418	600079	人福医药	67,396	707,658.00	0.05
419	600986	科达股份	165,520	700,149.60	0.05
420	601375	中原证券	132,300	699,867.00	0.05
421	600623	华谊集团	91,500	699,060.00	0.05
422	600777	新潮能源	333,999	694,717.92	0.05
423	600051	宁波联合	110,992	687,040.48	0.05
424	600435	北方导航	76,296	685,901.04	0.05
425	600037	XD 歌华有	66,537	682,004.25	0.05
426	600551	时代出版	71,810	651,316.70	0.05
427	600200	江苏吴中	110,700	650,916.00	0.05
428	600717	天津港	99,553	639,130.26	0.05
429	600293	三峡新材	154,400	636,128.00	0.05
430	603188	亚邦股份	80,400	631,140.00	0.04
431	600239	云南城投	213,450	619,005.00	0.04
432	600884	杉杉股份	57,494	612,311.10	0.04
433	601717	郑煤机	107,187	612,037.77	0.04
434	601689	拓普集团	39,108	599,134.56	0.04
435	600594	益佰制药	114,000	598,500.00	0.04
436	600651	飞乐音响	161,600	597,920.00	0.04
437	600657	信达地产	144,711	596,209.32	0.04
438	601801	皖新传媒	98,000	588,980.00	0.04
439	600485	信威集团	101,219	583,021.44	0.04
440	600306	商业城	72,600	582,978.00	0.04
441	600277	亿利洁能	119,600	582,452.00	0.04
442	600751	海航科技	180,275	573,274.50	0.04
443	601969	海南矿业	96,100	565,068.00	0.04
444	600291	西水股份	55,200	555,312.00	0.04
445	600223	鲁商置业	132,850	538,042.50	0.04
446	600284	浦东建设	69,783	537,329.10	0.04
447	600978	宜华生活	142,700	536,552.00	0.04

448	600881	亚泰集团	163,965	532,886.25	0.04
449	601208	东材科技	118,870	532,537.60	0.04
450	600693	东百集团	100,797	521,120.49	0.04
451	600123	兰花科创	71,185	521,074.20	0.04
452	600908	无锡银行	92,100	519,444.00	0.04
453	601515	东风股份	65,439	505,843.47	0.04
454	600685	中船防务	33,387	502,808.22	0.04
455	600682	南京新百	41,100	464,841.00	0.03
456	600525	长园集团	65,858	416,222.56	0.03
457	600261	阳光照明	108,424	397,916.08	0.03
458	601066	中信建投	18,290	385,553.20	0.03
459	600804	鹏博士	48,450	364,344.00	0.03
460	601003	柳钢股份	27,497	159,207.63	0.01
461	601828	美凯龙	12,705	154,365.75	0.01
462	600901	江苏租赁	23,635	143,937.15	0.01
463	601990	南京证券	9,930	98,406.30	0.01
464	603712	七一二	3,923	83,285.29	0.01
465	603267	鸿远电子	1,651	81,130.14	0.01
466	603379	三美股份	2,052	76,621.68	0.01
467	601330	绿色动力	4,874	75,595.74	0.01
468	603068	博通集成	1,231	71,373.38	0.01
469	603486	科沃斯	2,295	69,423.75	0.00
470	603697	有友食品	3,383	64,006.36	0.00
471	600829	人民同泰	8,743	61,813.01	0.00
472	603915	国茂股份	2,523	58,710.21	0.00
473	603056	德邦股份	4,049	57,009.92	0.00
474	603650	彤程新材	2,376	51,891.84	0.00
475	603967	中创物流	2,518	50,057.84	0.00
476	603317	天味食品	1,156	48,494.20	0.00
477	600929	湖南盐业	5,596	45,551.44	0.00
478	603982	泉峰汽车	1,845	42,121.35	0.00
479	603681	永冠新材	1,767	40,641.00	0.00
480	603348	文灿股份	2,011	36,962.18	0.00
481	603897	长城科技	1,595	31,900.00	0.00
482	603301	振德医疗	1,493	31,054.40	0.00
483	603596	伯特利	1,532	25,293.32	0.00
484	603045	福达合金	1,248	23,200.32	0.00
485	603080	新疆火炬	1,187	22,386.82	0.00
486	603655	朗博科技	880	14,106.40	0.00
487	600267	海正药业	88	880.00	0.00
488	600138	中青旅	42	532.98	0.00
489	600162	香江控股	23	56.12	0.00

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	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
2	603217	元利科技	584	39,268.16	0.00
3	603863	松炀资源	1,612	37,204.96	0.00
4	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
5	603867	新化股份	1,045	26,971.45	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	601288	农业银行	2,419,013.00	0.18
2	601857	中国石油	2,017,906.00	0.15
3	600036	招商银行	1,959,936.00	0.15
4	601988	中国银行	1,880,215.00	0.14
5	600519	贵州茅台	1,781,026.00	0.13
6	601318	中国平安	1,465,851.00	0.11
7	601328	交通银行	955,678.00	0.07
8	601628	中国人寿	953,221.00	0.07
9	600028	中国石化	896,846.00	0.07
10	601939	建设银行	689,831.00	0.05
11	601166	兴业银行	663,612.00	0.05
12	600900	长江电力	639,482.00	0.05
13	600000	浦发银行	558,087.00	0.04
14	601088	中国神华	535,131.99	0.04
15	600104	上汽集团	510,714.00	0.04
16	600276	恒瑞医药	477,999.00	0.04
17	603288	海天味业	425,163.00	0.03
18	601668	中国建筑	416,429.00	0.03
19	600016	民生银行	382,649.00	0.03
20	601601	中国太保	372,123.00	0.03

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	601288	农业银行	10,959,485.06	0.82
2	601857	中国石油	9,349,112.00	0.70
3	601988	中国银行	8,397,309.00	0.63

4	600036	招商银行	8,024,236.88	0.60
5	600519	贵州茅台	6,798,745.65	0.51
6	601318	中国平安	5,784,277.44	0.43
7	601328	交通银行	4,387,845.38	0.33
8	600028	中国石化	4,261,761.00	0.32
9	601628	中国人寿	4,143,533.85	0.31
10	601939	建设银行	3,097,469.49	0.23
11	601166	兴业银行	2,774,760.27	0.21
12	600900	长江电力	2,761,827.16	0.21
13	601088	中国神华	2,525,518.10	0.19
14	600000	浦发银行	2,406,038.00	0.18
15	600104	上汽集团	2,403,814.02	0.18
16	601668	中国建筑	2,010,724.20	0.15
17	600276	恒瑞医药	1,850,479.87	0.14
18	600518	ST 康美	1,834,931.08	0.14
19	600016	民生银行	1,703,965.00	0.13
20	601766	中国中车	1,686,581.00	0.13

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	48,553,372.60
卖出股票收入(成交)总额	215,540,660.23

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

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:本基金本报告期期末未持有国债期货投资。

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、证券交易所立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票未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	68,669.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,474.38
5	应收申购款	804,506.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	887,649.94

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	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	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
46,943	29,031.52	244,443,712.23	17.94	1,118,382,866.97	82.06

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	83,195.91	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	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(2009 年 7 月 1 日)基 金份额总额	9,097,758,651.47
本报告期期初基金份额总额	1,543,394,010.35
本报告期基金总申购份额	288,788,402.77
减：本报告期基金总赎回份额	469,355,833.92
本报告期基金拆分变动份额(份额减少 以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,362,826,579.20

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、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响公司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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单 元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
东方证券	2	261,367,788.28	100.00%	243,414.01	100.00%	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-

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	
	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
东方证券	407,933.80	100.00%	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-

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：

本基金本报告期内退租 3 家证券公司的 4 个交易单元：联讯证券（上交所单元）、江海证券（深交所单元）、民族证券（上交所单元和深交所单元）。

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 2018 年资产净值的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-01-01
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下 115 只基金 2018 年第 4 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2019-01-21
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加浙商银行为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-01-23
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大智慧基金为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-01-26
5	汇添富上证综合指数证券投资基金管理新招募说明书（2019 年第 1 号）	上证报, 公司网站	2019-02-13
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告（信威集团）	上证报, 公司网站	2019-02-15
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加前海财厚为代销机构并参与费率优惠活动的公告	证券时报, 公司网站	2019-03-22
8	汇添富基金旗下 115 只基金 2018 年年度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2019-03-26
9	汇添富基金旗下 123 只基金 2019 年第 1 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2019-04-20
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加西部证券为代销机构的公告	上证报, 公司网站	2019-06-22

§ 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上证综合指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富上证综合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、报告期内汇添富上证综合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电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2019 年 8 月 29 日