

汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式 证券投资基金（LOF）2019 年半年度报告摘 要

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

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）	
基金主代码	501057	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2018 年 5 月 23 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	373,204,842.03 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2018 年 6 月 20 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C
下属分级基金的交易代码	501057	501058
报告期末下属分级基金的份额总额	154,754,783.48 份	218,450,058.55 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，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	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	中证新能源汽车产业指数收益率×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，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	中国工商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

2.4 信息披露方式

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

§ 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)	
	汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF) A	汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF) C
本期已实现收益	-4,213,114.83	-3,380,047.40
本期利润	13,758,511.29	-6,186,253.54
加权平均基金份额本期利润	0.0815	-0.0375
本期基金份额净值增长率	7.20%	7.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.1766	-0.1797
期末基金资产净值	127,427,692.51	179,189,251.49
期末基金份额净值	0.8234	0.8203

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、上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

汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF) 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	0.65%	1.14%	0.25%	1.20%	0.40%	-0.06%
过去三个月	-9.87%	1.78%	-11.09%	1.83%	1.22%	-0.05%
过去六个月	7.20%	1.74%	6.21%	1.78%	0.99%	-0.04%
过去一年	-17.34%	1.64%	-21.25%	1.73%	3.91%	-0.09%
自基金合同生效日起至今	-17.66%	1.56%	-32.06%	1.73%	14.40%	-0.17%

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）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	0.63%	1.14%	0.25%	1.20%	0.38%	-0.06%
过去三个月	-9.93%	1.78%	-11.09%	1.83%	1.16%	-0.05%
过去六个月	7.09%	1.74%	6.21%	1.78%	0.88%	-0.04%
过去一年	-17.58%	1.64%	-21.25%	1.73%	3.67%	-0.09%
自基金合同生效日起至今	-17.97%	1.57%	-32.06%	1.73%	14.09%	-0.16%

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

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A 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



汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C 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（2018 年 5 月 23 日）起 6 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		
过蓓蓓	汇添富中证主要消费 ETF、汇添富中证医药卫生 ETF、汇添富中证能源 ETF、汇添富中证金融地产 ETF、汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 联接基金、汇添富主要消费 ETF 联接基金、汇添富中证生物科技指数（LOF）基金、汇添富中证中药指数（LOF）基金、汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）基金、中证银行 ETF 基金、添富中证医药 ETF 联接基金、添富中证银行 ETF 联接基金的基金经理。	2018 年 5 月 23 日	-	8	国籍：中国，学历：中国科学技术大学金融工程博士研究生，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理，2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费 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、汇添富中证主要消费 ETF 联接基金的基金经理，2015 年 8 月 18 日至今任汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理，2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技指数（LOF）基金的基金经理，2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证中药指数（LOF）基金的基金经理，2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）基金的基金经理，2018 年 10 月 23 日至今任中证银

					行 ETF 基金的基金经理，2019 年 3 月 26 日至今任添富中证医药 ETF 联接基金的基金经理，2019 年 4 月 15 日至今任添富中证银行 ETF 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。

本报告期内，基金管理人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。

本报告期内，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

本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 1 季度，A 股市场展开春季行情，主要股指上涨均超 25%，成交量大幅增加，2 月 25 日两市成交金额突破 1 万亿元。1 月末，大量的上市公司暴露出商誉减值风险和实质性商誉减值。市场对此解读较为正面，认为外延并购增长期间的泡沫将彻底出清，市场出现估值底。春节后市场表现更为强劲。3 月中旬开始，市场震荡加大，投资从概念、主题重回基本面。2 季度伊始，A 股市场行情焦灼，大盘价值股体现出明显的抗跌性，主要消费板块依然领涨，涨幅远超其他行业。5 月长假结束后第一天，特朗普突然发布拟提高关税的言论引发市场大跌。6 月末 G20 峰会上中美元首会晤使得中美贸易摩擦取得阶段性缓和，市场风险偏好恢复。

2019 年上半年，外部经济环境较为缓和，美联储利率稳定，展望偏鸽派，释放出今年结束缩表的信号。中美贸易谈判几经波折，在 6 月大阪峰会中美领导人会晤后，贸易摩擦的负面影响才逐渐缓解。国内宏观调控方面，政策仍然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，以对经济形成一定的支撑。两万亿减税力度超市场预期，反映出中央提出推进改革、稳定增长的信心和决定，企业运营成本迎来较大改善，为复苏和长期增长奠定基础。国内经济在上半年表现较为稳健，社融增速、PMI 等指标均呈现企稳特征，社零数据在二季度末也呈现企稳回升态势。通胀在二季度走高，主要是因为食品 CPI 贡献。

资金面方面，货币与信用政策的合理宽松是驱动行情的重要因素，通过陆股通北上的资金持续流入，也逐渐修复 2018 年悲观预期，修复风险偏好。

新能源汽车板块在 2019 年上半年弱于大盘，基本上主要是补贴退坡、中游产能出清对企业盈利的不利影响。2019 年上半年经济数据显示宏观经济仍处于弱势，汽车销量数据也尚未改观，产业链上企业盈利仍在磨底过程中。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位报告期内基本保持在 90%~95%之间，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 A 份额净值为 0.8234 元，本报告期 A 份额净值增长率为 7.20%；截至本报告期末，本基金 C 份额净值为 0.8203 元，本报告期 C 份额净值增长率为 7.09%；同期业绩比较基准增长率为 6.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年下半年，宏观政策预期仍以逆周期调节为主，主要消费维持稳定，可选消费下半年有望阶段性企稳。在“房住不炒”的政策大背景下，固定资产投资回落速度有可能超预期，利率有下行空间，利好股市及产业融资成本。

在地产大繁荣时期，经济金融领域普遍存在依赖土地快速增值的刚兑，隐性推高了利率水平，对产业融资及消费带来较大压力。未来随着房价的止涨甚至回落，以及刚兑的逐步打破，投资者更需要赚取经济增长带来的稳定收益，对于投资标的的把握也要以企业盈利增长为抓手，减少对于估值及弹性的零和博弈。

年中政治局会议继续强调“房住不炒”，并首次提出“不将房地产作为短期刺激经济的手段”，可以看出决策层的决心与定力。同时，强调要深挖国内需求潜力、拓展扩大最终需求，多用改革办法扩大消费，稳定制造业投资，实施城镇老旧小区改造、城市停车场、城乡冷链物流设施建设等补短板工程，加快推进信息网络等新型基础设施建设。会议定调的方向有利于汽车行业发展，不是继续采用购置税的刺激政策，而是采取了分区域的刺激终端需求，具体来看是刺激城市和农村的两块汽车消费。另一方面，环境保护及污染排放始终是红线，新能源汽车相对于传统燃油车能够获得的支持力度料更大。

作为被动投资的指数型基金，汇添富中证新能源汽车产业指数基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的指数化投资策略，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。

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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，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。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

本基金本报告期末未进行利润分配。

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中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）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，汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）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，汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）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中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）2019 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：汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	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	25,904,981.07	22,158,817.40
结算备付金	-	-
存出保证金	39,867.25	92,489.73
交易性金融资产	281,396,139.90	234,314,242.31
其中：股票投资	281,396,139.90	234,256,404.53
基金投资	-	-
债券投资	-	57,837.78
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	4,555.94	4,550.42
应收股利	-	-
应收申购款	142,154.20	65,206.79
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	307,487,698.36	256,635,306.65
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	178,411.60	103,615.63
应付管理人报酬	249,438.60	228,581.69
应付托管费	24,943.87	22,858.17
应付销售服务费	36,449.29	24,300.36
应付交易费用	111,627.38	1,847.07
应交税费	-	1.00
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	269,883.62	303,958.76
负债合计	870,754.36	685,162.68
所有者权益：		
实收基金	373,204,842.03	333,619,427.25
未分配利润	-66,587,898.03	-77,669,283.28
所有者权益合计	306,616,944.00	255,950,143.97
负债和所有者权益总计	307,487,698.36	256,635,306.65

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 373,204,842.03 份，其中汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A 基金份额总额为 154,754,783.48 份，基金份额净值 0.8234 元；汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C 基金份额总额为 218,450,058.55 份，基金份额净值 0.8203 元。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）

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	上年度可比期间 2018 年 5 月 23 日（基金合 同生效日）至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	9,666,856.86	-4,316,434.36
1. 利息收入	78,746.11	1,864,108.10
其中：存款利息收入	78,728.98	1,061,386.65
债券利息收入	17.13	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	802,721.45
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-5,720,759.14	362,636.63
其中：股票投资收益	-7,693,454.93	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	156.70	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,972,539.09	362,636.63
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	15,165,419.98	-6,774,943.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	143,449.91	231,764.31
减：二、费用	2,094,599.11	1,311,700.74
1. 管理人报酬	1,414,647.54	733,461.39

2. 托管费	141,464.77	73,346.16
3. 销售服务费	174,382.41	105,055.24
4. 交易费用	220,924.77	334,229.57
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	0.04	—
7. 其他费用	143,179.58	65,608.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	7,572,257.75	-5,628,135.10

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）

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）	333,619,427.25	-77,669,283.28	255,950,143.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	7,572,257.75	7,572,257.75
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）	39,585,414.78	3,509,127.50	43,094,542.28
其中：1. 基金申购款	147,701,841.88	-6,974,897.66	140,726,944.22
2. 基金赎回款	-108,116,427.10	10,484,025.16	-97,632,401.94
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）	373,204,842.03	-66,587,898.03	306,616,944.00
项目	上年度可比期间 2018 年 5 月 23 日（基金合同生效日）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）	742,196,052.24	-	742,196,052.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,628,135.10	-5,628,135.10
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）	-193,573,992.97	3,275,285.58	-190,298,707.39
其中：1. 基金申购款	611,341.54	-9,622.62	601,718.92
2. 基金赎回款	-194,185,334.51	3,284,908.20	-190,900,426.31
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）	548,622,059.27	-2,352,849.52	546,269,209.75

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

汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）（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[2017]2076 号文《关于准予汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司作为基金发起人于 2018 年 5 月 7 日至 2018 年 5 月 18 日向社会公开募集，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(2018)验字第 60466941_B26 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 2018 年 5 月 23 日生效。本基金为上市契约型开放式（LOF），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 742,028,722.81 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 167,329.43 元，

以上实收基金（本息）合计为人民币 742,196,052.24 元，折合 742,196,052.24 份基金份额。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，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）、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）、中小企业私募债券等）、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等）、货币市场工具、金融衍生工具（包括权证、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的相关规定）。本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金业绩比较基准为：中证新能源汽车产业指数收益率 $\times 95\%$ + 银行人民币活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

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发展费附加的单位外）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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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、基金发起人
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：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 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 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 （%）
东方证券股份有限公司	159,140,210.90	100.00	331,584,179.90	100.00

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：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 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 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 （%）
东方证券股份有限公司	59,590.68	100.00	—	—

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：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 5 月 23 日（基金合同生效日） 至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）
东方证券股份有限公司	-	-	1,485,800,000.00	100.00

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	146,288.34	100.00	111,627.38	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 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	304,818.92	100.00	304,818.92	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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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 5 月 23 日（基金合 同生效日）至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,414,647.54	733,461.39

其中：支付销售机构的客户维护费	131,049.73	62,255.22
-----------------	------------	-----------

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经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，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。

6.4.8.2.2 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 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	141,464.77	73,346.16

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，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取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 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。

6.4.8.2.3 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF) A	汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF) C	合计

汇添富基金管理股份有限公司	0	47,278.33	47,278.33
东方证券股份有限公司	0	6,907.91	6,907.91
中国工商银行股份有限公司	0	2,172.59	2,172.59
合计	0.00	56,358.83	56,358.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF) A	汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF) C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	0	1,105.05	1,105.05
东方证券股份有限公司	0	3,628.47	3,628.47
中国工商银行股份有限公司	0	579.91	579.91
合计	0.00	5,313.43	5,313.43

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 0.25%。

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 0.25% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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销售服务费划付指令，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，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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------	---------------------------------------

	汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) A	汇添富中证新能源汽车产业指 数 (LOF) C
基金合同生效日（2018 年 5 月 23 日）持有的基金份额	—	—
期初持有的基金份额	10,003,600.36	—
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,003,600.36	—
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	6.46%	—
项目	上年度可比期间 2018 年 5 月 23 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 5 月 23 日至 2018 年 6 月 30 日
	汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) A	汇添富中证新能源汽车产业指 数 (LOF) C
基金合同生效日（2018 年 5 月 23 日）持有的基金份额	10,003,600.36	—
期初持有的基金份额	—	—
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,003,600.36	—
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.77%	—

注：本公司于 2018 年 5 月 11 日用自有资金 10,001,000.00 元认购本基金份额 10,003,600.36 份（含募集期利息结转的份额），认购费用 1,000.00 元。符合招募说明书规定的认购费率。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 5 月 23 日（基金合同生效日）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	25,904,981.07	70,678.83	128,607,903.71	137,526.84
--------------	---------------	-----------	----------------	------------

6.4.8.6 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参与关联方承销证券。

6.4.9 期末(2019 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
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	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	281,396,139.90	91.51

	其中：股票	281,396,139.90	91.51
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	25,904,981.07	8.42
8	其他各项资产	186,577.39	0.06
9	合计	307,487,698.36	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	-	-
B	采矿业	14,069,088.00	4.59
C	制造业	264,508,567.14	86.27
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	2,244,601.00	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	280,822,256.14	91.59

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	195,693.75	0.06
C	制造业	248,443.97	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.01
J	金融业	33,869.94	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	33,165.74	0.01
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	573,883.76	0.19

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前十名股票投资明细

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前十名股票投资明细

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	600104	上汽集团	914,843	23,328,496.50	7.61
2	002594	比亚迪	434,500	22,037,840.00	7.19
3	603993	洛阳钼业	3,552,800	14,069,088.00	4.59

4	300124	汇川技术	501,400	11,487,074.00	3.75
5	002460	赣锋锂业	392,500	9,196,275.00	3.00
6	300450	先导智能	265,999	8,937,566.40	2.91
7	600066	宇通客车	683,700	8,901,774.00	2.90
8	002466	天齐锂业	344,500	8,708,960.00	2.84
9	002179	中航光电	258,480	8,648,740.80	2.82
10	002340	格林美	1,669,800	7,864,758.00	2.57

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.99fund.com 网站的半年度报告正文。

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前五名股票投资明细

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	600968	海油发展	55,125	195,693.75	0.06
2	603915	国茂股份	2,523	58,710.21	0.02
3	300779	惠城环保	1,047	54,485.88	0.02
4	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
5	603217	元利科技	584	39,268.16	0.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.99fund.com 网站的半年度报告正文。

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	603993	洛阳钼业	9,612,508.00	3.76
2	002594	比亚迪	7,264,305.03	2.84
3	600104	上汽集团	6,321,240.00	2.47
4	300124	汇川技术	3,450,257.76	1.35
5	600525	长园集团	3,315,183.40	1.30
6	300450	先导智能	3,051,919.00	1.19
7	002466	天齐锂业	2,960,460.10	1.16
8	002460	赣锋锂业	2,722,697.47	1.06
9	002340	格林美	2,715,419.00	1.06
10	600066	宇通客车	2,594,745.00	1.01
11	000625	长安汽车	2,302,815.00	0.90
12	300750	宁德时代	2,228,149.34	0.87
13	603799	华友钴业	2,206,722.00	0.86
14	002050	三花智控	2,206,266.81	0.86
15	300014	亿纬锂能	2,091,750.00	0.82
16	002074	国轩高科	2,070,606.40	0.81

17	002179	中航光电	2,003,624.00	0.78
18	600699	均胜电子	1,981,793.90	0.77
19	603659	璞泰来	1,915,260.69	0.75
20	300618	寒锐钴业	1,724,486.00	0.67

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	600104	上汽集团	3,830,522.00	1.50
2	002249	大洋电机	3,403,636.00	1.33
3	002594	比亚迪	3,253,519.00	1.27
4	600525	长园集团	2,728,432.00	1.07
5	300124	汇川技术	2,413,238.00	0.94
6	002466	天齐锂业	2,112,699.29	0.83
7	002460	赣锋锂业	1,939,930.00	0.76
8	300750	宁德时代	1,681,428.00	0.66
9	002050	三花智控	1,515,369.52	0.59
10	002179	中航光电	1,484,111.00	0.58
11	000625	长安汽车	1,477,861.00	0.58
12	600066	宇通客车	1,475,647.85	0.58
13	603799	华友钴业	1,441,794.50	0.56
14	600699	均胜电子	1,327,183.15	0.52
15	300450	先导智能	1,223,821.82	0.48
16	603993	洛阳钼业	1,203,150.00	0.47
17	002340	格林美	1,159,862.00	0.45
18	600549	厦门钨业	1,156,682.90	0.45
19	600885	宏发股份	1,059,894.84	0.41
20	300444	双杰电气	1,010,918.80	0.39

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	100,192,398.40
卖出股票收入（成交）总额	60,523,065.86

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投资。

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投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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：本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、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	39,867.25
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	4,555.94
5	应收申购款	142,154.20
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	186,577.39

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

§ 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（%）
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	5,078	30,475.54	11,766,043.03	7.60	142,988,740.45	92.40
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C	3,851	56,725.54	105,377,573.11	48.24	113,072,485.44	51.76
合计	8,929	41,796.94	117,143,616.14	31.39	256,061,225.89	68.61

8.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	叶伟华	1,193,430.00	2.99
2	耒阳市国有资产投资经营有限公司	995,249.00	2.50
3	廖秀银	995,114.00	2.50
4	关继泉	995,114.00	2.50
5	吴新容	995,069.00	2.50
6	杨雄	995,069.00	2.50
7	吴燕琼	990,000.00	2.48
8	杨燕芳	792,115.00	1.99
9	丘红兵	495,094.00	1.24
10	张成科	485,168.00	1.22

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	秦杰	1,130,050.00	7.11

2	应向群	1,000,270.00	6.29
3	韦雅萍	1,000,045.00	6.29
4	黄赦慈	497,057.00	3.13
5	朱爱芬	310,334.00	1.95
6	毛文广	300,027.00	1.89
7	陈文辉	300,013.00	1.89
8	黄翠玲	300,013.00	1.89
9	方云	300,013.00	1.89
10	钟志和	250,067.00	1.57

8.3 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	汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF) A	38,057.71	0.02
	汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) C	7,834.01	0.00
	合计	45,891.72	0.01

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF) A	0
	汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF) A	0
	汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) C	0
	合计	0

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,003,600.36	2.68	10,003,600.36	2.68	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—

基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	45,891.72	0.01	-	-	-
合计	10,049,492.08	2.69	10,003,600.36	2.68	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) A	汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2018 年 5 月 23 日)		
基金份额总额	310,738,440.50	431,457,611.74
本报告期期初基金份额总额	192,303,723.13	141,315,704.12
本报告期基金总申购份额	15,636,480.40	132,065,361.48
减：本报告期基金总赎回份额	53,185,420.05	54,931,007.05
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	154,754,783.48	218,450,058.55

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	2	159,140,210.90	100.00%	146,288.34	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	59,590.68	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）。

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	2019 年 4 月 19 日至 2019 年 6 月 30 日	—	102,176,356.39	—	102,176,356.39	27.38
个人	—	—	—	—	—	—	—

产品特有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

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

2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金规模低于 2 亿元人民币的，本基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。《基金合同》生效后继续存续的，持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

汇添富基金管理股份有限公司

2019 年 8 月 29 日