

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 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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	63
7.1 期末基金资产组合情况	63
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	64
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	65
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	76
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	78
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	78
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	78
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	78
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	79

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	79
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	79
7.12 投资组合报告附注.....	79
§ 8 基金份额持有人信息	81
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	81
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	81
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	82
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.....	82
§ 9 开放式基金份额变动	82
§ 10 重大事件揭示	83
10.1 基金份额持有人大会决议.....	83
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.....	83
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	83
10.4 基金投资策略的改变.....	83
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	83
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.....	83
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	83
10.8 其他重大事件.....	85
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	86
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.....	86
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
§ 12 备查文件目录	87
12.1 备查文件目录.....	87
12.2 存放地点	87
12.3 查阅方式	87

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	添富中证长三角 ETF
场内简称	长三角
基金主代码	512650
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 07 月 26 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	1,456,941,627.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 10 月 25 日

注：本基金扩位证券简称为长三角 ETF。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证长三角一体化发展主题指数收益率
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	上海浦东发展银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李鹏	司
	联系电话	021-28932888	021-61618888
	电子邮箱	service@99fund.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95528
传真		021-28932998	021-63602540
注册地址		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	上海市中山东一路 12 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼	上海市北京东路 689 号
邮政编码		200120	200001
法定代表人		李文	郑杨

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 01 月 01 日 - 2021 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	82,120,564.66
本期利润	123,178,119.34
加权平均基金份额本期利润	0.0836
本期加权平均净值利润率	6.54%
本期基金份额净值增长率	6.63%
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	355,522,821.39

期末可供分配基金份额利润	0.2440
期末基金资产净值	1,958,462,897.90
期末基金份额净值	1.3442
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	34.42%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.66%	0.99%	1.15%	0.98%	0.51%	0.01%
过去三个月	10.04%	1.03%	8.91%	1.03%	1.13%	0.00%
过去六个月	6.63%	1.30%	5.23%	1.30%	1.40%	0.00%
过去一年	27.53%	1.31%	21.49%	1.33%	6.04%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	34.42%	1.29%	36.84%	1.32%	-2.42%	-0.03%

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

添富中证长三角ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2019 年 07 月 26 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立。目前，公司注册资本金为 132,724,224 元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
乐无穹	本基金的基金经理	2019 年 07 月 26 日		7	国籍:中国。学历:复旦大学经济学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月 15 日至今任中证银行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 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 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至今

					任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
吴振翔	本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监	2019 年 07 月 26 日		15	国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。从业资格:证券投资基金从业资格。 从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。 2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11

				月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。 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。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。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。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中的公平交易模块进行操作，实现事前和事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的溢价率进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，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。

政策方面，7 月 7 日召开国务院常务会议，决定加大金融对实体经济的支持，针对大宗商品价格上涨对企业生产经营的影响，要在坚持不搞大水漫灌的基础上，保持货币政策稳定性、增强有效性，适时运用降准等货币政策工具，进一步加强金融对实体经济特别是中小微企业的支持，促进综合融资成本稳中有降。

资金面上，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。但是市场对于美联储货币收紧的预期已经较为充分，边际影响较小。

一季度市场受到通胀预期等的影响出现了一定的调整，前期涨幅较大的消费、医药、科技等主题均出现幅度较大的回撤。二季度以来通胀预期降温、流动性相对充裕，市场迎来反弹。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。下半年，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。此外，十四五规划中首次写入“碳达峰、碳中和”，资本市场对能源环境领域的关注度持续提升，碳中和将是未来较长一段时间内的重要投资主题。

“长江三角洲区域一体化发展”是国家级区域发展战略，是区域间融合互补的重要举措之一。长三角 ETF 是投资于长三角区域龙头上市企业的指数产品，能够帮助投资者把握长三角区域发展带来的主题投资机遇。

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 95%~100%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

本基金本报告期基金份额净值增长率为 6.63%。同期业绩比较基准收益率为 5.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着全球范围内的疫情常态化和经济的重启，针对特殊时期的相关政策未来将会陆续退出。而海外经济对刺激政策的依赖已经产生，政策回归常态化需要一定的尝试和博弈过程。

国内经济相对来说韧性更足，下半年预计季度增速温和回落，整体大概率能够维持稳健。货币政策方面延续宽货币、紧信用的组合，保持流动性相对稳定。

资本市场在流动性环境变动不大的情况下，不论方向，出现整体趋势性行情的概率不大，

预计仍然以结构性行情为主。当前不同板块的估值差异较大，价值类资产具备配置性价比，而长期具备空间的成长类资产，在短期外部因素扰动之下容易出现较大波动，需要充分的业绩增长予以支撑。全球比较来看，A 股仍然具有极佳的整体配置价值。

长三角区域是中国最重要的经济区域之一，孕育了大量优质的上市公司，中证长三角一体化发展主题指数集合区域内优质 A 股上市公司，并进行了进一步优选。长三角 ETF 跟踪中证长三角一体化发展主题指数，遵循被动投资的运作方法，将严格遵守基金合同，坚持既定的投资策略，积极采取有效方法控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部、风险管理及合规稽核人员、基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配采用现金分红；《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对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托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对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投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由汇添富基金管理股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：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

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	43,056,773.88	37,428,943.05
结算备付金		16,912,467.37	21,368,740.44
存出保证金		7,728,095.50	8,171,764.14

交易性金融资产	6.4.7.2	1,890,518,163.73	1,839,106,933.30
其中：股票投资		1,887,138,092.22	1,838,640,933.30
基金投资		-	-
债券投资		3,380,071.51	466,000.00
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		1,158,167.88	961,451.21
应收利息	6.4.7.5	90,181.18	142,358.63
应收股利		164,304.60	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,959,628,154.14	1,907,180,190.77
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		659.11	973,385.67
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		234,748.51	235,753.29
应付托管费		78,249.53	78,584.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	613,619.03	725,717.43
应交税费		2.02	100,796.58
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	237,978.04	350,425.76
负债合计		1,165,256.24	2,464,663.14
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,456,941,627.00	1,510,941,627.00
未分配利润	6.4.7.1 0	501,521,270.90	393,773,900.63
所有者权益合计		1,958,462,897.90	1,904,715,527.63
负债和所有者权益总计		1,959,628,154.14	1,907,180,190.77

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3442 元，基金份额总额 1,456,941,627.00 份。

6.2 利润表

会计主体：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

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日 至 2020 年 06 月 30 日
一、收入		126,592,829.12	80,000,039.03
1. 利息收入		1,122,857.85	932,528.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	316,865.75	928,414.09
债券利息收入		1,492.41	1,052.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		804,499.69	3,062.41
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		84,169,154.78	58,909,625.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	65,549,543.51	24,818,472.02
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	2,269,629.63	1,601,553.77
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	2,362,448.74	1,028,970.87
股利收益	6.4.7.17	13,987,532.90	31,460,629.27
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	41,057,554.68	19,008,341.45
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	243,261.81	1,149,542.82
减：二、费用		3,414,709.78	9,543,727.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,404,359.85	2,862,065.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	468,120.02	954,021.70
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	1,144,031.08	5,048,338.90
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		17,302.90	3,707.53
7. 其他费用	6.4.7.21	380,895.93	675,593.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		123,178,119.34	70,456,311.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		123,178,119.34	70,456,311.79

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	1,510,941,627.00	393,773,900.63	1,904,715,527.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	123,178,119.34	123,178,119.34
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）	-54,000,000.00	-15,430,749.07	-69,430,749.07
其中：1. 基金申购款	22,000,000.00	6,696,566.82	28,696,566.82
2. 基金赎回款	-76,000,000.00	-22,127,315.89	-98,127,315.89
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）	1,456,941,627.00	501,521,270.90	1,958,462,897.90
项目	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,684,941,627.00	91,688,894.53	4,776,630,521.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	70,456,311.79	70,456,311.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,764,000,000.00	-4,475,507.37	-1,768,475,507.37

(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	22,000,000.00	-272,988.29	21,727,011.71
2. 基金赎回款	-1,786,000,000.00	-4,202,519.08	-1,790,202,519.08
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)	2,920,941,627.00	157,669,698.95	3,078,611,325.95

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:

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
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

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(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[2019]779号《关于准予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注册的批复》准予募集注册,由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集,基金合同于2019年7月26日正式生效,首次设立募集规模为6,428,941,627.00份基金份额。本基金为交易型开放式,存续期限不定。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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规

定。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。本基金的投资目标为紧密跟踪标的指数，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长三角一体化发展主题指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资

基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

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

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

6.4.6.5 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自 2008 年 10 月 9 日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
活期存款	43,056,773.88
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	43,056,773.88

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		1,506,621,233.52	1,887,138,092.22	380,516,858.70
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,232,900.00	3,380,071.51	147,171.51
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	3,232,900.00	3,380,071.51	147,171.51
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,509,854,133.52	1,890,518,163.73	380,664,030.21

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	62,239,860.00	-	-	-
（股指期货投资）	62,239,860.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	62,239,860.00	-	-	-

注：本期末 2021 年 6 月 30 日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量(买/卖)	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
IF2107	41	62,239,860.00	63,851,760.00	1,611,900.00

总额合计：	1,611,900.00
减：可抵销期货暂收款	1,611,900.00
股指期货投资净额：	0.00

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	9,222.21
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	6,923.98
应收债券利息	255.89
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	73,749.50
其他	29.60
合计	90,181.18

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	613,619.03
银行间市场应付交易费用	-
合计	613,619.03

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	138,799.09
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	237,978.04

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,510,941,627.00	1,510,941,627.00
本期申购	22,000,000.00	22,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-76,000,000.00	-76,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,456,941,627.00	1,456,941,627.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	284,221,261.06	109,552,639.57	393,773,900.63
本期利润	82,120,564.66	41,057,554.68	123,178,119.34
本期基金份额交易产生的变动数	-10,819,004.33	-4,611,744.74	-15,430,749.07
其中：基金申购款	4,410,955.70	2,285,611.12	6,696,566.82
基金赎回款	-15,229,960.03	-6,897,355.86	-22,127,315.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	355,522,821.39	145,998,449.51	501,521,270.90

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	153,339.60
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	161,864.41
其他	1,661.74
合计	316,865.75

注：“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	55,695,806.62
股票投资收益——赎回差价收入	9,853,736.89
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	65,549,543.51

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	380,470,301.31
减：卖出股票成本总额	324,774,494.69
买卖股票差价收入	55,695,806.62

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	98,127,315.89
减：现金支付赎回款总额	39,218,420.89
减：赎回股票成本总额	49,055,158.11
赎回差价收入	9,853,736.89

6.4.7.12.4 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
出借证券现金清偿总额	—
减：出借证券成本总额	—
减：应收证券出借利息	—
证券出借差价收入	—

6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,510,193.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,239,300.00
减：应收利息总额	1,264.24
买卖债券差价收入	2,269,629.63

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
外汇期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-
买卖权证差价收入	-
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	2,362,448.74
卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入应缴纳增值税	-

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	13,987,532.90
其中：证券出借权益补偿收入	658,218.04
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,987,532.90

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	42,176,614.68
——股票投资	42,029,443.17
——债券投资	147,171.51
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-1,119,060.00
——权证投资	-
——期货投资	-1,119,060.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	41,057,554.68

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	243,261.81
其他	-
合计	243,261.81

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	1,144,031.08
银行间市场交易费用	-
合计	1,144,031.08

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	845.00
指数使用费	280,871.98
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	380,895.93

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
上海浦东发展银行股份有限公司 (“浦发银行”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	687,299,690.42	93.20	2,590,819,978.55	80.42

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	12,510,193.87	100.00	6,268,046.19	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	634,365.36	95.39	605,947.74	98.75
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	2,397,104.83	86.14	1,008,542.84	80.85

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,404,359.85	2,862,065.13
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日

日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	468,120.02	954,021.70

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	-	-	-	-
上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	4,632,200.00	3,062.41	-	-

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 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	43,056,773.88	153,339.60	129,878,024.00	612,277.88

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

本基金根据基金合同和招募书约定的投资策略，按照标的指数的成分股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理人的股东东方证券发行的股票东方证券及基金托管人浦发银行发行的股票浦发银行。

于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 846,900.00 股，持有浦发银行 2,691,356.00 股。

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	成功流	可流	流通	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称	认购日	通日	受限类型		单价	位：股)			
301018	申菱环境	2021年06月28日	2022年01月07日	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	
300955	嘉亨家化	2021年03月16日	2021年09月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	
300945	曼卡龙	2021年02月03日	2021年08月10日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	
605287	德才股份	2021年06月28日	2021年07月06日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	
300952	恒辉安防	2021年03月03日	2021年09月13日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	
301015	百洋医药	2021年06月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	
300979	华利集团	2021年04月	2021年10月	新股流通	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	

		15 日	26 日	受 限						
300996	普联软件	2021年05月26日	2021年12月03日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	
300957	贝泰妮	2021年03月18日	2021年09月27日	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	
300966	共同药业	2021年03月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	
300991	创益通	2021年05月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	
300992	泰福泵业	2021年05月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	
301010	晶雪节能	2021年06月09日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	
301016	雷尔伟	2021年06月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	

688533	上声电子	2021年04月09日	2021年10月19日	新股流通受限	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	
300614	百川畅银	2021年05月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	
688685	迈信林	2021年04月30日	2021年11月15日	新股流通受限	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	
688619	罗普特	2021年02月08日	2021年08月23日	新股流通受限	19.31	26.74	5,856	113,079.36	156,589.44	
688613	奥精医疗	2021年05月13日	2021年11月22日	新股流通受限	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	
300995	奇德新材	2021年05月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	
688499	利元亨	2021年06月23日	2021年07月01日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	
301017	漱玉	2021年	2022年	新股	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	

	平民	06月23日	01月05日	流通受限						
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2021年07月05日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	
300973	立高食品	2021年04月08日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	
688269	凯立新材	2021年06月01日	2021年12月09日	新股流通受限	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	
301018	申菱环境	2021年06月28日	2021年07月07日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	
300958	建工修复	2021年03月18日	2021年09月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	
301021	英诺激光	2021年06月28日	2021年07月06日	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	
301011	华立科技	2021年06月	2021年12月	新股流通	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	

		09 日	17 日	受 限						
300993	玉马遮阳	2021年05月17日	2021年11月24日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	
300950	德固特	2021年02月24日	2021年09月03日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	
300942	易瑞生物	2021年02月02日	2021年08月09日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	
300967	晓鸣股份	2021年04月02日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	
300997	欢乐家	2021年05月26日	2021年12月02日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	
300929	华骐环保	2021年01月12日	2021年07月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	
300943	春晖智控	2021年02月03日	2021年08月10日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	

688655	迅捷兴	2021年04月28日	2021年11月11日	新股流通受限	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	
300972	万辰生物	2021年04月08日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	
301007	德迈仕	2021年06月04日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	
300948	冠中生态	2021年02月18日	2021年08月25日	新股流通受限	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	
300982	苏文电能	2021年04月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	
300981	中红医疗	2021年04月19日	2021年10月27日	新股流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	
300971	博亚精工	2021年04月07日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	
605162	新	2021年	2021年	新股	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	

	中 港	06 月 29 日	07 月 07 日	流 通 受 限						
300986	志特新材	2021年04月21日	2021年11月01日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	
301021	英诺激光	2021年06月28日	2022年01月06日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	
300930	屹通新材	2021年01月13日	2021年07月21日	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	
300968	格林精密	2021年04月06日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	
301012	扬电科技	2021年06月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	
688226	威腾电气	2021年06月28日	2021年07月07日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	
300933	中辰股份	2021年01月	2021年07月	新股流通	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	

		15 日	22 日	受 限						
688621	阳光 诺和	2021 年06 月11 日	2021 年12 月21 日	新 股 流 通 受 限	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	
688087	英科 再生	2021 年06 月30 日	2021 年07 月09 日	新 股 流 通 受 限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	
300962	中金 辐照	2021 年03 月29 日	2021 年10 月11 日	新 股 流 通 受 限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	可 流 通 日	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
113050	南 银 转 债	2021 年06 月16 日	2021 年07 月01 日	新 债 流 通 受 限	100.00	100.00	27,580	2,758,000.00	2,758,000.00	

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
002024	苏宁易购	2021年06月16日	重大资产重组	5.59	2021年07月06日	6.15	726,000	6,888,544.31	4,058,340.00	
600460	士兰微	2021年06月30日	重大资产重组	56.35	2021年07月01日	59.49	241,000	6,181,638.18	13,580,350.00	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日		期末估值单价	数量(单位：张)	期末估值总额
1	002415	海康威视	2021年07月01日	2021年07月01日	64.50	194700	12,558,150.00
2	603501	韦尔股份	2021年07月01日	2021年07月01日	322.00	24200	7,792,400.00
3	002142	宁	2021	2021	38.97	147300	5,740,281.00

		波 银 行	年 07 月 01 日	年 07 月 01 日			
4	002230	科 大 讯 飞	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	67.58	81000	5,473,980.00
5	300782	卓 胜 微	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	537.50	10000	5,375,000.00
6	300274	阳 光 电 源	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	115.06	45600	5,246,736.00
7	600763	通 策 医 疗	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	411.00	10000	4,110,000.00
8	002304	洋 河 股 份	2021 年 07 月 05 日	- 2021 年 07 月 05 日	207.20	18900	3,916,080.00
9	601328	交 通 银 行	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	4.90	721700	3,536,330.00
10	600196	复 星 医 药	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 12 日	72.13	41500	2,993,395.00
11	601100	恒 立 液 压	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	85.92	30000	2,577,600.00
12	000425	徐 工 机 械	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	6.37	365300	2,326,961.00
13	002001	新 和 成	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	28.68	80400	2,305,872.00
14	002064	华	2021	- 2021	14.20	150300	2,134,260.00

		峰 化 学	年 07 月 01 日	年 07 月 01 日			
15	601233	桐 昆 股 份	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	24.09	85300	2,054,877.00
16	600460	士 兰 微	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	56.35	35800	2,017,330.00
17	600584	长 电 科 技	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	37.68	44100	1,661,688.00
18	002223	鱼 跃 医 疗	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	38.13	40700	1,551,891.00
19	603806	福 斯 特	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	105.13	14200	1,492,846.00
20	600585	海 螺 水 泥	2021 年 07 月 12 日	- 2021 年 07 月 12 日	41.05	33300	1,366,965.00
21	600926	杭 州 银 行	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	14.75	90600	1,336,350.00
22	000963	华 东 医 药	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	46.01	28600	1,315,886.00
23	600570	恒 生 电 子	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	93.25	13200	1,230,900.00
24	002493	荣 盛 石 化	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 12 日	17.27	71000	1,226,170.00
25	002080	中	2021	- 2021	26.17	45800	1,198,586.00

		材 科 技	年 07 月 01 日	年 07 月 01 日			
26	002607	中 公 教 育	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	20.89	52000	1,086,280.00
27	600352	浙 江 龙 盛	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	13.74	78100	1,073,094.00
28	600704	物 产 中 大	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	7.87	132000	1,038,840.00
29	600406	国 电 南 瑞	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	23.24	43680	1,015,123.20
30	603816	顾 家 家 居	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	77.28	11300	873,264.00
31	300595	欧 普 康 视	2021 年 07 月 05 日	- 2021 年 07 月 05 日	103.55	8400	869,820.00
32	300253	卫 宁 健 康	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	16.27	53000	862,310.00
33	600019	宝 钢 股 份	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	7.64	111800	854,152.00
34	002555	三 七 互 娱	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	24.02	35400	850,308.00
35	300088	长 信 科 技	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	8.26	102700	848,302.00
36	300999	金	2021	- 2021	84.96	9800	832,608.00

		龙鱼	年 07 月 05 日	年 07 月 05 日			
37	300009	安科生物	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	14.90	54000	804,600.00
38	603005	晶方科技	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	59.23	13500	799,605.00
39	600398	海澜之家	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	7.24	101800	737,032.00
40	002602	世纪华通	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	6.42	110800	711,336.00
41	000739	普洛药业	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	29.40	24100	708,540.00
42	002127	南极电商	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	9.77	72200	705,394.00
43	002250	联化科技	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	27.90	24400	680,760.00
44	601788	光大证券	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	17.89	37800	676,242.00
45	603456	九洲药业	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	48.58	13900	675,262.00
46	600655	豫园股份	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	11.59	58100	673,379.00
47	601688	华	2021	- 2021	15.80	42600	673,080.00

		泰 证 券	年 07 月 01 日	年 07 月 01 日			
48	601555	东 吴 证 券	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	8.34	79500	663,030.00
49	600521	华 海 药 业	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	20.88	31300	653,544.00
50	002032	苏 泊 尔	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	63.79	10000	637,900.00
51	688008	澜 起 科 技	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	62.38	10000	623,800.00
52	002236	大 华 股 份	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	21.10	29100	614,010.00
53	300357	我 武 生 物	2021 年 07 月 05 日	- 2021 年 07 月 05 日	64.12	9400	602,728.00
54	601689	拓 普 集 团	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	37.43	16100	602,623.00
55	600315	上 海 家 化	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	60.14	10000	601,400.00
56	601878	浙 商 证 券	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	13.08	45400	593,832.00
57	000728	国 元 证 券	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	7.97	70900	565,073.00
58	002010	传	2021	- 2021	7.71	72600	559,746.00

		化 智 联	年 07 月 01 日	年 07 月 01 日			
59	600216	浙 江 医 药	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	16.01	34200	547,542.00
60	002156	通 富 微 电	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	24.04	21400	514,456.00
61	600487	亨 通 光 电	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	11.40	43700	498,180.00
62	601009	南 京 银 行	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	10.52	45500	478,660.00
63	600688	上 海 石 化	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	3.76	126900	477,144.00
64	000581	威 孚 高 科	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	20.83	22700	472,841.00
65	601877	正 泰 电 器	2021 年 07 月 12 日	- 2021 年 07 月 12 日	33.38	13200	440,616.00
66	601155	新 城 控 股	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	41.60	10000	416,000.00
67	601990	南 京 证 券	2021 年 07 月 05 日	- 2021 年 07 月 05 日	10.52	37400	393,448.00
68	600663	陆 家 嘴	2021 年 07 月 05 日	- 2021 年 07 月 05 日	13.32	29100	387,612.00
69	002048	宁	2021	- 2021	19.50	19700	384,150.00

		波 华 翔	年 07 月 01 日	年 07 月 01 日			
70	002563	森 马 服 饰	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 05 日	11.95	31900	381,205.00
71	002085	万 丰 奥 威	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 05 日	5.60	67900	380,240.00
72	600115	中 国 东 航	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	5.08	70100	356,108.00
73	600637	东 方 明 珠	2021 年 07 月 05 日	- 2021 年 07 月 05 日	8.19	42600	348,894.00
74	601872	招 商 轮 船	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	4.62	73920	341,510.40
75	000887	中 鼎 股 份	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	12.08	26500	320,120.00
76	603885	吉 祥 航 空	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	15.26	18400	280,784.00
77	601928	凤 凰 传 媒	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 05 日	7.14	37100	264,894.00
78	300226	上 海 钢 联	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	59.55	4300	256,065.00
79	600699	均 胜 电 子	2021 年 07 月 12 日	- 2021 年 07 月 12 日	25.52	10000	255,200.00
80	002091	江	2021	- 2021	9.10	26900	244,790.00

		苏 国 泰	年 07 月 01 日	年 07 月 01 日			
81	002120	韵 达 股 份	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	13.53	18000	243,540.00
82	000559	万 向 钱 潮	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	5.31	43500	230,985.00
83	601828	美 凯 龙	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	12.00	19200	230,400.00
84	002131	利 欧 股 份	2021 年 07 月 05 日	- 2021 年 07 月 05 日	2.34	97700	228,618.00
85	600909	华 安 证 券	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	5.57	39900	222,243.00
86	002244	滨 江 集 团	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 05 日	4.19	53000	222,070.00
87	601696	中 银 证 券	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	20.59	10000	205,900.00
88	600026	中 远 海 能	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	6.16	32700	201,432.00
89	600021	上 海 电 力	2021 年 07 月 05 日	- 2021 年 07 月 05 日	6.91	28800	199,008.00
90	300894	火 星 人	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	68.00	2900	197,200.00
91	600710	苏	2021	- 2021	6.18	31400	194,052.00

		美达	年 07 月 01 日	年 07 月 01 日			
92	601231	环旭电子	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	16.81	10800	181,548.00
93	000961	中南建设	2021 年 07 月 12 日	- 2021 年 07 月 12 日	5.92	29600	175,232.00
94	600633	浙数文化	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	7.18	21700	155,806.00
95	600176	中国巨石	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	15.51	10000	155,100.00
96	600823	世茂股份	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	4.04	34400	138,976.00
97	000156	华数传媒	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	7.71	14200	109,482.00
98	601801	皖新传媒	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	4.72	21000	99,120.00
99	601018	宁波港	2021 年 07 月 01 日	- 2021 年 07 月 01 日	3.95	10000	39,500.00
合计	-	-	-	-	-	5,341,400	119,178,222.60

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告‘本基金持有的流通受限证券’部分内容。

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同责任，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的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 202 1 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	43,056,773.88	-	-	-	-	-	43,056,773.88
结 算 备 付 金	16,912,467.37	-	-	-	-	-	16,912,467.37
存 出 保 证	65,884.30	-	-	-	-	7,662,211.20	7,728,095.50

金							
交易性金融资产	-	-	3,380,071.51	-	-	1,887,138,092.22	1,890,518,163.73
应收股利	-	-	-	-	-	164,304.60	164,304.60
应收利息	-	-	-	-	-	90,181.18	90,181.18
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,158,167.88	1,158,167.88
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-

资产							
资产总计	60,035,125.55	-	3,380,071.51	-	-	1,896,212,957.08	1,959,628,154.14
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	234,748.51	234,748.51
应付托管费	-	-	-	-	-	78,249.53	78,249.53
应付证券清算款	-	-	-	-	-	659.11	659.11
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销	-	-	-	-	-	-	-

售 服 务 费							
应付 交 易 费 用	-	-	-	-	-	613,619.03	613,619.03
应 交 税 费	-	-	-	-	-	2.02	2.02
应 付 利 息	-	-	-	-	-	-	-
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
其 他 负 债	-	-	-	-	-	237,978.04	237,978.04
负 债 总 计	-	-	-	-	-	1,165,256.24	1,165,256.24
利 率 敏 感 度 缺 口	60,035,125.55	-	3,380,071.51	-	-	1,895,047,700.84	1,958,462,897.90
上 年 度 末 202 0 年 12	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

月 31 日							
资产							
银行 存款	37,428,943.0 5	-	-	-	-	-	37,428,943.05
结 算 备 付 金	21,368,740.4 4	-	-	-	-	-	21,368,740.44
存 出 保 证 金	474,474.54	-	-	-	-	7,697,289.60	8,171,764.14
交 易 性 金 融 资 产	-	-	466,000.00	-	-	1,838,640,933. 30	1,839,106,933. 30
应 收 股 利	-	-	-	-	-	-	-
应 收 利 息	-	-	-	-	-	142,358.63	142,358.63
应 收 申 购 款	-	-	-	-	-	-	-
衍 生 金 融 资	-	-	-	-	-	-	-

产							
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	961,451.21	961,451.21
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	59,272,158.03	-	466,000.00	-	-	1,847,442,032.74	1,907,180,190.77
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 管理人 报酬	-	-	-	-	-	235,753.29	235,753.29
应付 托管 费	-	-	-	-	-	78,584.41	78,584.41
应	-	-	-	-	-	973,385.67	973,385.67

付 证 券 清 算 款							
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	-	-	-	-	-	-	-
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	-	-
应 付 交 易 费 用	-	-	-	-	-	725,717.43	725,717.43
应 交 税 费	-	-	-	-	-	100,796.58	100,796.58
应 付 利 息	-	-	-	-	-	-	-
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
其 他 负 债	-	-	-	-	-	350,425.76	350,425.76

负债总计	-	-	-	-	-	2,464,663.14	2,464,663.14
利率敏感度缺口	59,272,158.03	-	466,000.00	-	-	1,844,977,369.60	1,904,715,527.63

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	1,887,138,09	96.36	1,838,640,93	96.53

	2.22		3.30	
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	3,380,071.51	0.17	466,000.00	0.02
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	1,890,518,163.73	96.53	1,839,106,933.30	96.56

注：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不得低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	中证长三角一体化发展主题指数上涨 5%	96,491,134.39	93,519,705.04
	中证长三角一体化发展主题指数下跌 5%	-96,491,134.39	-93,519,705.04

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	1,887,138,092.22	96.30
	其中：股票	1,887,138,092.22	96.30
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	3,380,071.51	0.17
	其中：债券	3,380,071.51	0.17
	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	59,969,241.25	3.06
8	其他资产	9,140,749.16	0.47
9	合计	1,959,628,154.14	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 119,178,222.60 元，占期末基金资产净值比例 6.09%。

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	3,048,837.00	0.16
C	制造业	1,011,987,468.14	51.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,611,051.00	0.64
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	43,704,146.61	2.23
G	交通运输、仓储和邮政业	33,222,754.47	1.70
H	住宿和餐饮业	5,518,455.00	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	140,720,482.31	7.19
J	金融业	403,505,092.60	20.60
K	房地产业	35,968,065.96	1.84
L	租赁和商务服务业	9,978,924.42	0.51
M	科学研究和技术服务业	80,794,489.58	4.13
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	8,855,521.68	0.45
Q	卫生和社会工作	86,936,883.00	4.44
R	文化、体育和娱乐业	7,916,629.00	0.40
S	综合	—	—

	合计	1,884,768,800.77	96.24
--	----	------------------	-------

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,897,471.51	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	76,061.58	0.00
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	178,997.27	0.01
J	金融业	34,721.10	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	95,025.15	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	37,332.80	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,369,291.45	0.12

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	2,890,079	94,765,690.41	4.84

		富			
2	002415	海康威视	1,298,971	83,783,629.50	4.28
3	603501	韦尔股份	260,092	83,749,624.00	4.28
4	603259	药明康德	515,962	80,794,489.58	4.13
5	600276	恒瑞医药	982,703	66,794,322.91	3.41
6	600763	通策医疗	115,402	47,430,222.00	2.42
7	600585	海螺水泥	996,400	40,902,220.00	2.09
8	002142	宁波银行	1,001,149	39,014,776.53	1.99
9	300782	卓胜微	70,956	38,138,850.00	1.95
10	002230	科大讯飞	541,000	36,560,780.00	1.87
11	300274	阳光电源	304,400	35,024,264.00	1.79
12	600570	恒生电子	346,547	32,315,507.75	1.65
13	600837	海通证券	2,512,500	28,893,750.00	1.48
14	600000	浦发银行	2,691,356	26,913,560.00	1.37
15	601211	国泰君安	1,550,200	26,570,428.00	1.36
16	002304	洋河股份	126,128	26,133,721.60	1.33
17	600104	上汽集团	1,186,301	26,063,032.97	1.33
18	603799	华友钴业	207,800	23,730,760.00	1.21
19	601328	交通银行	4,798,500	23,512,650.00	1.20
20	002493	荣盛石化	1,325,650	22,893,975.50	1.17
21	600196	复星医药	315,400	22,749,802.00	1.16
22	600919	江苏银行	3,094,247	21,969,153.70	1.12
23	300347	泰格医	110,084	21,279,237.20	1.09

		药			
24	601100	恒立液 压	232,007	19,934,041.44	1.02
25	600741	华域汽 车	754,700	19,825,969.00	1.01
26	600019	宝钢股 份	2,552,900	19,504,156.00	1.00
27	601601	中国太 保	672,103	19,470,823.91	0.99
28	601229	上海银 行	2,302,900	18,883,780.00	0.96
29	603486	科沃斯	81,331	18,549,974.48	0.95
30	600176	中国巨 石	1,181,487	18,324,863.37	0.94
31	000425	徐工机 械	2,811,700	17,910,529.00	0.91
32	600406	国电南 瑞	718,820	16,705,376.80	0.85
33	300595	欧普康 视	156,490	16,204,539.50	0.83
34	601688	华泰证 券	1,025,600	16,204,480.00	0.83
35	002001	新 和 成	540,700	15,507,276.00	0.79
36	002050	三花智 控	613,556	14,713,072.88	0.75
37	601009	南京银 行	1,375,400	14,469,208.00	0.74
38	002064	华峰化 学	1,009,900	14,340,580.00	0.73
39	601233	桐昆股 份	577,443	13,910,601.87	0.71
40	600460	士兰微	241,000	13,580,350.00	0.69
41	300450	先导智 能	211,460	12,717,204.40	0.65
42	300244	迪安诊 断	311,204	11,919,113.20	0.61
43	601607	上海医 药	558,300	11,796,879.00	0.60
44	601799	星宇股 份	50,726	11,449,872.72	0.58
45	601155	新城控 股	274,700	11,427,520.00	0.58

46	600584	长电科技	293,700	11,066,616.00	0.57
47	002223	鱼跃医疗	273,764	10,438,621.32	0.53
48	603899	晨光文具	120,500	10,189,480.00	0.52
49	603806	福斯特	94,981	9,985,352.53	0.51
50	600926	杭州银行	645,442	9,520,269.50	0.49
51	000963	华东医药	195,261	8,983,958.61	0.46
52	002236	大华股份	421,497	8,893,586.70	0.45
53	002607	中公教育	423,912	8,855,521.68	0.45
54	601877	正泰电器	263,800	8,805,644.00	0.45
55	600958	东方证券	846,900	8,460,531.00	0.43
56	603659	璞泰来	60,500	8,264,300.00	0.42
57	002080	中材科技	308,207	8,065,777.19	0.41
58	600522	中天科技	794,400	7,944,000.00	0.41
59	601108	财通证券	751,900	7,887,431.00	0.40
60	600845	宝信软件	149,100	7,589,190.00	0.39
61	002508	老板电器	159,522	7,417,773.00	0.38
62	300033	同花顺	65,187	7,351,789.86	0.38
63	600704	物产中大	924,400	7,275,028.00	0.37
64	688008	澜起科技	116,600	7,273,508.00	0.37
65	600606	绿地控股	1,325,900	7,226,155.00	0.37
66	600352	浙江龙盛	519,200	7,133,808.00	0.36
67	600009	上海机场	147,819	7,114,528.47	0.36
68	688298	东方生物	31,400	6,832,640.00	0.35

69	002384	东山精密	319,800	6,664,632.00	0.34
70	002555	三七互娱	271,900	6,531,038.00	0.33
71	600061	国投资本	744,816	6,323,487.84	0.32
72	002044	美年健康	692,460	6,308,310.60	0.32
73	000596	古井贡酒	25,700	6,155,150.00	0.31
74	002463	沪电股份	396,700	6,136,949.00	0.31
75	603816	顾家家居	75,800	5,857,824.00	0.30
76	601727	上海电气	1,369,600	5,807,104.00	0.30
77	300999	金龙鱼	67,800	5,760,288.00	0.29
78	603195	公牛集团	28,400	5,736,800.00	0.29
79	300253	卫宁健康	352,570	5,736,313.90	0.29
80	300558	贝达药业	52,616	5,695,155.84	0.29
81	600023	浙能电力	1,543,200	5,663,544.00	0.29
82	600486	扬农化工	50,500	5,644,385.00	0.29
83	300088	长信科技	683,200	5,643,232.00	0.29
84	600642	申能股份	915,100	5,618,714.00	0.29
85	600018	上港集团	1,169,700	5,579,469.00	0.28
86	600754	锦江酒店	96,900	5,518,455.00	0.28
87	601916	浙商银行	1,383,795	5,493,666.15	0.28
88	300009	安科生物	363,296	5,413,110.40	0.28
89	002032	苏泊尔	82,300	5,249,917.00	0.27
90	688099	晶晨股份	46,300	5,194,860.00	0.27

91	002252	上海莱士	690,400	5,171,096.00	0.26
92	600398	海澜之家	692,400	5,012,976.00	0.26
93	002624	完美世界	209,500	5,009,145.00	0.26
94	603605	珀莱雅	24,900	4,898,079.00	0.25
95	688188	柏楚电子	10,900	4,752,400.00	0.24
96	000739	普洛药业	160,900	4,730,460.00	0.24
97	002602	世纪华通	735,933	4,724,689.86	0.24
98	002127	南极电商	481,746	4,706,658.42	0.24
99	600699	均胜电子	183,000	4,670,160.00	0.24
100	002409	雅克科技	56,300	4,560,300.00	0.23
101	002250	联化科技	162,598	4,536,484.20	0.23
102	601788	光大证券	252,400	4,515,436.00	0.23
103	603456	九洲药业	92,700	4,503,366.00	0.23
104	600655	豫园股份	386,065	4,474,493.35	0.23
105	600521	华海药业	213,030	4,448,066.40	0.23
106	601555	东吴证券	530,390	4,423,452.60	0.23
107	603005	晶方科技	74,672	4,422,822.56	0.23
108	603260	合盛硅业	57,500	4,422,325.00	0.23
109	600315	上海家化	73,500	4,420,290.00	0.23
110	600895	张江高科	234,300	4,280,661.00	0.22
111	300144	宋城演艺	254,285	4,271,988.00	0.22
112	300357	我武生物	65,900	4,225,508.00	0.22

113	600827	百联股份	207,851	4,188,197.65	0.21
114	002024	苏宁易购	726,000	4,058,340.00	0.21
115	601689	拓普集团	107,500	4,023,725.00	0.21
116	601878	浙商证券	301,800	3,947,544.00	0.20
117	600177	雅戈尔	582,000	3,835,380.00	0.20
118	600216	浙江医药	236,300	3,783,163.00	0.19
119	000728	国元证券	472,690	3,767,339.30	0.19
120	002010	传化智联	484,600	3,736,266.00	0.19
121	600848	上海临港	204,960	3,668,784.00	0.19
122	000961	中南建设	591,700	3,502,864.00	0.18
123	600115	中国东航	686,300	3,486,404.00	0.18
124	002156	通富微电	142,700	3,430,508.00	0.18
125	600663	陆家嘴	257,528	3,430,272.96	0.18
126	603290	斯达半导	10,700	3,424,000.00	0.17
127	601021	春秋航空	58,500	3,328,650.00	0.17
128	600487	亨通光电	290,200	3,308,280.00	0.17
129	600688	上海石化	846,400	3,182,464.00	0.16
130	000581	威孚高科	151,800	3,161,994.00	0.16
131	002048	宁波华翔	161,314	3,145,623.00	0.16
132	600637	东方明珠	378,800	3,102,372.00	0.16
133	688029	南微医学	9,800	3,054,562.00	0.16
134	002120	韵达股份	225,700	3,053,721.00	0.16
135	600985	淮北矿	249,700	3,048,837.00	0.16

		业			
136	002131	利欧股份	1,292,900	3,025,386.00	0.15
137	600377	宁沪高速	291,200	2,842,112.00	0.15
138	603236	移远通信	16,270	2,775,824.70	0.14
139	002966	苏州银行	371,300	2,729,055.00	0.14
140	601231	环旭电子	161,900	2,721,539.00	0.14
141	002019	亿帆医药	157,000	2,708,250.00	0.14
142	688088	虹软科技	48,000	2,676,000.00	0.14
143	002563	森马服饰	222,800	2,662,460.00	0.14
144	601990	南京证券	249,460	2,624,319.20	0.13
145	002085	万丰奥威	452,900	2,536,240.00	0.13
146	603707	健友股份	60,720	2,535,060.00	0.13
147	603301	振德医疗	57,527	2,526,585.84	0.13
148	600612	老凤祥	47,100	2,494,887.00	0.13
149	688126	沪硅产业	84,900	2,477,382.00	0.13
150	601696	中银证券	114,600	2,359,614.00	0.12
151	601018	宁波港	585,800	2,313,910.00	0.12
152	601872	招商轮船	493,200	2,278,584.00	0.12
153	600909	华安证券	400,380	2,230,116.60	0.11
154	002124	天邦股份	317,358	2,224,679.58	0.11
155	601928	凤凰传媒	301,000	2,149,140.00	0.11
156	000887	中鼎股份	177,300	2,141,784.00	0.11
157	603885	吉祥航空	123,200	1,880,032.00	0.10

158	600850	电科数字	67,100	1,805,661.00	0.09
159	600597	光明乳业	124,200	1,789,722.00	0.09
160	300226	上海钢联	28,680	1,707,894.00	0.09
161	002091	江苏国泰	179,400	1,632,540.00	0.08
162	600420	国药现代	164,900	1,624,265.00	0.08
163	000559	万向钱潮	295,900	1,571,229.00	0.08
164	601828	美凯龙	128,000	1,536,000.00	0.08
165	002244	滨江集团	359,100	1,504,629.00	0.08
166	603515	欧普照明	56,400	1,447,788.00	0.07
167	605358	立昂微	11,953	1,381,527.74	0.07
168	300894	火星人	19,900	1,353,200.00	0.07
169	600026	中远海能	218,400	1,345,344.00	0.07
170	600021	上海电力	192,300	1,328,793.00	0.07
171	600710	苏美达	209,500	1,294,710.00	0.07
172	600073	上海梅林	147,800	1,210,482.00	0.06
173	601456	国联证券	78,100	1,202,740.00	0.06
174	688158	优刻得	30,400	1,193,200.00	0.06
175	300682	朗新科技	62,400	1,049,568.00	0.05
176	600633	浙数文化	145,000	1,041,100.00	0.05
177	600823	世茂股份	229,500	927,180.00	0.05
178	603786	科博达	12,186	920,043.00	0.05
179	601801	皖新传媒	161,500	762,280.00	0.04
180	000156	华数传媒	95,100	733,221.00	0.04

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	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.02
2	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
3	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.01
4	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.01
5	688619	罗普特	5,856	156,589.44	0.01
6	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.01
7	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.00
8	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
9	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
10	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
11	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
12	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
13	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
14	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.00
15	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
16	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.00
17	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
18	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
19	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
20	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
21	605208	永茂泰	801	17,485.83	0.00
22	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00

23	300968	格林精密	1,220	14,941.74	0.00
24	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
25	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
26	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
27	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
28	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
29	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
30	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
31	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
32	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
33	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
34	300948	冠中生态	379	10,474.13	0.00
35	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
36	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
37	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
38	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
39	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
40	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
41	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
42	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
43	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
44	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
45	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
46	300930	屹通新	322	7,882.56	0.00

		材			
47	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
48	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
49	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
50	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
51	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
52	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
53	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
54	300995	奇德新材	209	5,008.52	0.00
55	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
56	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
57	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
58	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
59	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	603501	韦尔股份	29,881,129.00	1.57
2	300274	阳光电源	29,781,305.52	1.56
3	603259	药明康德	23,307,711.55	1.22
4	603486	科沃斯	15,954,700.60	0.84
5	002142	宁波银行	15,234,396.00	0.80
6	300450	先导智能	14,550,263.20	0.76
7	000425	徐工机械	11,149,409.00	0.59
8	002415	海康威视	8,226,271.00	0.43
9	600176	中国巨石	7,755,867.73	0.41

10	600919	江苏银行	7,504,804.30	0.39
11	600741	华域汽车	7,181,200.00	0.38
12	603659	璞泰来	7,174,726.80	0.38
13	601233	桐昆股份	7,173,941.60	0.38
14	300999	金龙鱼	6,237,385.63	0.33
15	688298	东方生物	5,957,639.89	0.31
16	600104	上汽集团	5,612,164.23	0.29
17	601607	上海医药	5,044,927.97	0.26
18	601229	上海银行	4,699,734.00	0.25
19	600000	浦发银行	4,580,002.42	0.24
20	601100	恒立液压	4,496,353.60	0.24

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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	300059	东方财富	26,115,677.40	1.37
2	600276	恒瑞医药	13,506,804.35	0.71
3	002236	大华股份	13,213,136.51	0.69
4	300558	贝达药业	13,048,475.27	0.69
5	002304	洋河股份	11,053,621.35	0.58
6	601155	新城控股	9,795,215.00	0.51
7	603899	晨光文具	9,150,739.87	0.48
8	600177	雅戈尔	7,573,882.42	0.40
9	002493	荣盛石化	7,518,516.37	0.39
10	300033	同花顺	7,328,316.44	0.38
11	600196	复星医药	7,227,703.00	0.38
12	000961	中南建设	6,679,250.00	0.35
13	600406	国电南瑞	6,608,946.05	0.35
14	000963	华东医药	6,544,191.24	0.34
15	600606	绿地控股	6,450,303.00	0.34
16	002001	新 和 成	6,429,330.08	0.34
17	601877	正泰电器	6,230,464.00	0.33
18	300347	泰格医药	5,537,398.00	0.29
19	600170	上海建工	5,318,585.00	0.28
20	002555	三七互娱	4,956,970.00	0.26

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	364,560,215.55
卖出股票收入（成交）总额	380,470,301.31

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）	3,380,071.51	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,380,071.51	0.17

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	113050	南银转债	27,580	2,758,000.00	0.14
2	127036	三花转债	4,749	622,071.51	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2107	IF2107	41.00	63,851,760.00	1,611,900.00	
公允价值变动总额合计					1,611,900.00
股指期货投资本期收益					2,362,448.74
股指期货投资本期公允价值变动					-1,119,060.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，南京银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,728,095.50
2	应收证券清算款	1,158,167.88
3	应收股利	164,304.60
4	应收利息	90,181.18
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,140,749.16

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002415	海康威视	12,558,150.00	0.64	转融通出借流通受限
2	603501	韦尔股份	7,792,400.00	0.40	转融通出借流通受限
3	002142	宁波银行	5,740,281.00	0.29	转融通出借流通受限
4	002230	科大讯飞	5,473,980.00	0.28	转融通出借流通受限
5	300782	卓胜微	5,375,000.00	0.27	转融通出借流通受限
6	600763	通策医疗	4,110,000.00	0.21	转融通出借流通受限
7	600585	海螺水泥	1,366,965.00	0.07	转融通出借流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	-----------	----------

				(%)	
1	300957	贝泰妮	214,921.88	0.01	新股流通受限
2	688269	凯立新材	195,885.72	0.01	新股流通受限
3	688613	奥精医疗	166,179.50	0.01	新股流通受限
4	688619	罗普特	156,589.44	0.01	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		上海浦东发展银行股份有限公司—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	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
499	2,919,722.70	1,281,290,427.00	87.94	175,651,200.00	12.06	63,905,000.00	4.39

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“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“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例 (%)
1	浙江省能源集团有限公司	859,999,500.00	59.03
2	宁波开发投资集团有限公司	352,354,426.00	24.18
3	汤奇青	172,106,000.00	11.81

4	方正证券股份有限公司	2,361,400.00	0.16
5	中信证券股份有限公司	2,242,601.00	0.15
6	华泰证券股份有限公司	317,000.00	0.02
7	王棟	290,000.00	0.02
8	李春旺	229,400.00	0.02
9	王安	200,000.00	0.01
10	程子刚	169,400.00	0.01
11	上海浦东发展银行股份有限公司 — 中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数 证券投资联接基金	63,905,000.00	4.39

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年07月26日）基金份额总额	6,428,941,627.00
本报告期期初基金份额总额	1,510,941,627.00
本报告期基金总申购份额	22,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	76,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,456,941,627.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、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	687,299,690.42	93.20	634,365.36	95.39	
中信证券	3	50,154,018.13	6.80	30,659.19	4.61	
东北证券	2	—	—	—	—	
申万宏源证券	2	—	—	—	—	
浙商证券	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	12,510,193.87	100.00	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源证券	—	—	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—	—	—

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:

本基金本报告期内新增 2 家证券公司的 3 个交易单元:东北证券(上交所单元,深交所单元)、浙商证券(上交所单元)。

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	汇添富基金旗下 164 只基金 2020 年 4 季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021 年 01 月 22 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2020 年年度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021 年 03 月 30 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金修订的招募说明书、产品资料概要	上交所,公司网站,深交所	2021 年 04 月 02 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021 年 04 月 22 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加第一创业为申购赎回代理券商的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021 年 05 月 19 日
7	汇添富基金管理股份有限公司	上交所,上证报,公司	2021 年 06 月 09 日

	关于旗下部分基金增加中信证券华南为申购赎回代理券商的公告	网站, 深交所	
8	汇添富基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 06 月 24 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中金财富证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 06 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 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	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	859,999,500.00	-	-	859,999,500.00	59.03
	2	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	352,354,426.00	-	-	352,354,426.00	24.18
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、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。

3、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

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募集的文件；

2、《中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《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