中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2020年4月15日更新)

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

重要提示

中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金(基金简称:汇添富中证金融地产ETF,基金代码:159931,以下简称"本基金")经2013年6月6日中国证券监督管理委员会证监许可【2013】758号文核准募集。本基金基金合同于2013年8月23日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者拟认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等等。

本基金更新招募说明书"基金的投资"章节中有关"风险收益特征"的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述,代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行"销售适当性风险评价",不同的销售机构采用的评价方法也不同,因此销售机构的基金产品"风险等级评价"与"基金的投资"章节中"风险收益特征"的表述可能存在不同,投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

本基金是跟踪中证金融地产指数的交易型开放式基金,投资本基金可能遇到的风险包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力等等。

本基金场内申购、赎回流程可采用"实物申购赎回"和"深市股票实物申赎、沪市股票现金替代"两种模式。其中,"实物申购赎回"通过中国证券登记结算有限责任公司办理,"深市股票实物申赎、沪市股票现金替代"通过深圳证券交易所办理。"实物申购赎回"模式中投资者的申购、赎回申请在T+1日确认, 申购所得ETF份额及赎回所得组合证券在T+2日可用。通常情况下,"深市股票实物申赎、沪市股票现金替代"模式中投资者的申购、赎回申请在T日确认,申购所得ETF份额T可以卖出,T+1日可以赎回;T日买入的ETF份额,T日可赎回,T+1日可卖出;T日赎回所得组合证券在T日卖出,T+1日可申购;T日赎回得到的深市成份券现金替代和沪市成份券现金替代的资金,T日可用。如投资者需要通过申购赎回代理券商参与本基金并采用"实物申购赎回"模式,则应同时持有并使用深圳A股账户与上海A股账户, 且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资者所有,同时用以申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管证券公司和上海A股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理券商。

本基金是股票型基金,属于证券投资基金中的高风险品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。投资者应充分考虑自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本招募说明书更新截止日为2020年4月15日, 有关财务数据和净值表现截止日为2019年12月31日。

一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

名称:汇添富基金管理股份有限公司

住所:上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室

办公地址:上海市富城路99号震旦国际大楼20楼

法定代表人:李文

成立时间: 2005年2月3日

批准设立机关:中国证券监督管理委员会

批准设立文号:证监基金字[2005]5号

注册资本:人民币132,724,224元

联系人:李鹏

联系电话:021–28932888

股东名称及其出资比例:

股东名称	股权比例
东方证券股份有限公司	35.412%
上海菁聚金投资管理合伙企业(有限合伙)	24.656%
上海上报资产管理有限公司	19.966%
东航金控有限责任公司	19.966%
合计	100%

(二)主要人员情况

1、董事会成员

李文先生,2015年4月16日担任董事长。国籍:中国,厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长,汇添富资产管理(香港)有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处科长, 中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局杏林支局副行长、副局长,中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处长,东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理,稽核总部总经理,东方证券有限责任公司资金财务管理总部总经理,汇添富基金管理股份有限公司督察长。

程峰先生,2016年11月20日担任董事。国籍:中国,上海交通大学工商管理硕士。现任上海报业集团副总经理, 上海上报资产管理有限公司董事长,上海文化产权交易所股份有限公司董事长,上海瑞力投资基金管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会团委副书记、书记,上海机械进出口(集团)有限公司副总裁,上海市对外经济贸易委员会技术进口处副处长,上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长、处长,上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任,上海国际集团有限公司行政管理总部总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长,上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。

林福杰先生,2018年3月21日担任董事。国籍:中国,上海交通大学工商管理硕士。现任东航金控有限责任公司总经理、党委副书记、东航集团财务有限责任公司董事长。曾任东航期货有限责任公司部门经理, 东航集团财务有限责任公司副总经理, 国泰人寿保险有限责任公司副总经理,东航金控有限责任公司副总经理。

张晖先生,2015年4月16日担任董事,总经理。国籍:中国,上海财经大学经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理, 汇添富资本管理有限公司董事长。历任申银万国证券研究所高级分析师, 富国基金管理有限公司研究主管和基金经理,汇添富基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监,曾担任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

林志军先生,2015年4月16日担任独立董事。国籍:中国香港,厦门大学经济学博士,加拿大Saskatchewan大学工商管理理学硕士。现任澳门科技大学副校长兼商学院院长、教授、博导。历任福建省科学技术委员计划财务处会计,五大国际会计师事务所Touche Ross International(现为德勤) 加拿大多伦多分所审计员,厦门大学会计师事务所副主任会计师,厦门大学经济学院讲师、副教授,伊利诺大学(University of Illinois)国际会计教育与研究中心访问学者, 美国斯坦福大学(Stanford University)经济系访问学者,加拿大Lethbridge大学管理学院会计学讲师、副教授 (tenured),香港大学商学院访问教授,香港浸会大学商学院会计与法律系教授,博导,系主任。

杨燕青女士,2011年12月19日担任独立董事,国籍:中国,复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑,第一财经研究院院长,国家金融与发展实验室特邀高级研究员, 上海政协委员,《第一财经日报》创始编委之一,第一财经频道高端对话节目《经济学人》等栏目创始人和主持人,《波士堂》等栏目资深评论员。2002–2003年期间受邀成为约翰–霍普金斯大学访问学者。

魏尚进(Shangjin Wei)先生,2020年1月9日担任独立董事,国籍:美国, 加州大学伯克利分校博士。现任复旦大学泛海国际金融学院访问教授、哥伦比亚大学终身讲席教授。曾任哈佛大学肯尼迪政府学院助理教授、副教授,世界银行顾问,国际货币基金组织工作贸易与投资处处长、研究局助理局长。

2、监事会成员

任瑞良先生,2004年10月20日担任监事,2015年6月30日担任监事会主席。国籍:中国,大学学历,会计师、非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上报资产管理有限公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管, 文汇新民联合报业集团文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理等。

王如富先生,2015年9月8日担任监事。国籍:中国,硕士研究生,注册会计师。现任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任。历任申银万国证券计划统筹总部综合计划部专员、 发展协调办公室专员,金信证券规划发展总部总经理助理、秘书处副主任(主持工作),东方证券研究所证券市场战略资深研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

毛海东先生,2015年6月30日担任监事,国籍:中国,国际金融学硕士。现任东航金控有限责任公司总经理助理兼财富管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责任公司,东航集团财务有限责任公司。

王静女士,2008年2月23日担任职工监事,国籍:中国,中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部,东航金控有限责任公司研究发展部。

林旋女士,2008年2月23日担任职工监事,国籍:中国,华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监,汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生,2013年8月8日担任职工监事,国籍:中国,北京大学学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司,泰科电子(上海)有限公司能源事业部。

3、高管人员

李文先生,董事长。(简历请参见上述董事会成员介绍)

张晖先生,2015年6月25日担任总经理。(简历请参见上述董事会成员介绍)

雷继明先生,2012年3月7日担任副总经理。国籍:中国,工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理, 中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011年12月加盟汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理。

娄焱女士,2013年1月7日担任副总经理。国籍:中国,金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处工作,负责投资银行、证券投资研究,以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理。

袁建军先生,2015年8月5日担任副总经理。国籍:中国,金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理,汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理,并于2014年至2015年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005年4月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。

李骁先生,2017年3月3日担任副总经理。国籍:中国,武汉大学金融学硕士。历任厦门建行计算机处副处长,厦门建行信用卡部副处长、处长,厦门建行信息技术部处长,建总行北京开发中心负责人,建总行信息技术管理部副总经理,建总行信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任,建总行信息技术管理部资深专员(副总经理级)。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席技术官。

李鹏先生,2015年6月25日担任督察长。国籍:中国,上海财经大学经济学博士,历任上海证监局主任科员、副处长,上海农商银行同业金融部副总经理,汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

4、基金经理

(1)现任基金经理

过蓓蓓女士,国籍:中国,学历:中国科学技术大学金融工程博士研究生,9年证券从业经验。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,2019年10月8日至今任添富中证800ETF基金的基金经理。

(2)历任基金经理

汪洋先生,2013年9月13日至2015年1月6日任汇添富中证金融地产ETF基金的基金经理。

吴振翔先生,2013年8月23日至2015年11月2日任汇添富中证金融地产ETF基金的基金经理。

5、投资决策委员会

主席:袁建军(副总经理)

成员:韩贤旺(首席经济学家)、王栩(总经理助理,权益投资总监)、陆文磊(总经理助理,固定收益投资总监)、劳杰男(研究总监)

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日

法定代表人: 陈四清

注册资本:人民币35,640,625.7089万元

联系电话:010–66105799

联系人:郭明

(二)主要人员情况

截至2019年9月,中国工商银行资产托管部共有员工208人,平均年龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2019年9月,中国工商银行共托管证券投资基金1006只。自2003年以来, 本行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的68项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

一、基金销售机构

1、直销机构

(1)汇添富基金管理股份有限公司直销中心

住所:上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室

办公地址:上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼

法定代表人:李文

电话:(021)28932893

传真:(021)50199035或(021)50199036

联系人:陈卓膺

客户服务电话:400–888–9918(免长途话费)

邮箱:guitai@htffund.com

网址:www.99fund.com

(2) 汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统(trade.99fund.com)

2、申购赎回代理券商

本基金的申购赎回代理券商请详见基金管理人官网公示的销售机构信息表。基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其他符合要求的机构代理销售基金,并在基金管理人网站公示。

3、二级市场交易代理券商

本基金办理二级市场交易业务的销售机构为具有基金销售业务资格、经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。具体会员单位名单可在深圳证券交易所网站查询。

二、登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京市西城区太平桥大街17号

办公地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:金颖

联系人:严峰、朱立元

电话:0755–25946013、010–59378839

传真:010–59378907

三、律师事务所和经办律师

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:俞卫锋

电话:(021)31358666

传真:(021)31358600

经办律师:吕红、黎明

联系人:陈颖华

四、会计师事务所和经办注册会计师

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

邮政编码:100738

执行事务合伙人:毛鞍宁

电话: 010–58153000

传真: 010–85188298

业务联系人:徐艳

经办会计师:徐艳、许培菁

四、基金的名称

本基金名称:中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金

基金简称:汇添富中证金融地产ET

基金代码:159931

五、基金的类型

本基金为股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(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、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产的90%,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会决定。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

本基金主要采取完全复制法,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动进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,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。

特殊情况包括但不限于以下情形:(1)法律法规的限制;(2)标的指数成份股流动性严重不足;(3)标的指数的成份股票长期停牌;(4)其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

在正常市场情况下, 本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%,年化跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的,基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品,如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则, 以提高投资效率, 更好达到本基金的投资目标。基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易费用、降低跟踪误差的目的,不得将之应用于投机目的,或用作杠杆工具放大基金的投资。

(二)投资组合管理

1、构建投资组合

构建本基金投资组合的过程主要分为三步:确定目标组合、制定建仓策略和逐步组合调整。

本基金采取完全复制法确定目标组合,根据指数成份股的流动性和需买入数量建立基金的建仓策略,在基金合同生效之日起3个月内,按照建仓策略将不低于90%的基金资产投资于标的指数成份股、备选成份股。此后,如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的,基金管理人将在规定期限内进行调整。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如因流动性欠佳而无法完成建仓的某些成份股将采用合理方法寻求替代。

2、日常投资组合管理

(1)可能引起跟踪误差各种因素的跟踪与分析:基金管理人将对标的指数成份股的调整、股本变化、分红、停/复牌、市场流动性、标的指数编制方法的变化、基金每日申购赎回情况等因素进行密切跟踪,分析其对指数跟踪的影响。

(2)投资组合的调整:利用数量化分析模型,优选组合调整方案,并利用ETF投资管理系统适时调整投资组合, 以实现更好的跟踪标的指数的目的。

(3)对比指数与组合的每日及累计的绩效数据,检测跟踪误差及其趋势:分析由于组合每只股票构成与指数构成的差异导致的跟踪误差的程度与趋势以找出跟踪误差的来源,进而决定需要对组合调整的部分及调整方法,并初步制定下一交易日的投资组合调整方案。

(4)制作并公布申购赎回清单:以T–1 日基金持有的证券及其比例为基础,根据上市公司公告,考虑T 日可能发生的上市公司变动情况,制作T 日的申购赎回清单并公告。

3、定期投资组合管理

基金管理人将定期(每月或每半年)进行投资组合管理,主要完成下列事项:

(1)定期对投资组合的跟踪误差进行归因分析,制定改进方案,经投资决策委员会审批后实施;

(2)根据标的指数的编制规则及调整公告,制定组合调整方案,经投资决策委员会审批后实施;

(3)根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求,及时检查组合中现金的比例,进行每月支付现金的准备。

4、投资绩效评估

(1)每日对基金的绩效评估进行,主要是对跟踪偏离度和跟踪误差进行评估;

(2)每月末,金融工程部对本基金的运行情况进行量化评估;

(3)每月末,基金经理根据量化评估报告,重点分析本基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金的控制情况、标的指数调整成份股前后的操作、未来成份股的变化等。

(三)投资决策依据和投资程序

1、投资决策依据

(1)国家有关法律、法规和基金合同的规定;

(2)标的指数的相关规定;

(3)《汇添富基金管理股份有限公司章程》的有关规定;

(4)《汇添富基金管理股份有限公司投资管理制度》的有关规定。

2、投资决策机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

(1)投资决策委员会的主要职能

本基金管理人设立的投资决策委员会是本基金投资的最高决策机构。投资决策委员会的主要职责包括:

1)负责决定有关指数重大调整的应对决策;

2)负责决定其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;

3)审核评估基金经理每季提交的投资运作季报。

(2)基金经理的主要职责

基金经理的主要职责包括:

1)决定正常市场情况下,日常指数跟踪过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制决策;

2)必要时进行本基金跟踪偏离的分析;

3)每季向投资决策委员会提交本基金的投资运作季报;

4)撰写基金中报、年报等公开报告关于基金投资运作的相关部分。

3、投资程序

本基金投资程序分为投资研究、投资决策、投资执行(组合构建与监控调整)、交易执行、投资绩效评估、投资核对与监督、组合监控与调整、投资风险管理八个环节。

(1)投资研究

基金经理依托公司研究平台,开展指数跟踪、成份股流动性、成份股更新预测、成份股公司基本面情况(以期尽早发现退市风险)、成份股公司行为等相关研究,同时开展对本基金跟踪偏离的归因分析,并撰写报告,作为基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策

投资决策委员会依据基金经理提供的研究报告,定期或遇重大事项时召开投资决策会议, 决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理的日常决策。

定期事项是指:每季初投资决策委员会对基金的操作进行指导与决策,基金经理根据公司投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作;

重大事项是指:成份股更新、成份股发生合并、清算、破产等退市类事件、成份股长期停牌等事件。

(3)投资执行(组合构建与监控调整)

根据标的指数,结合研究报告,基金经理以完全复制指数成份股权重方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下, 基金经理将采取适当的方法,以降低买入成本、控制投资风险。

(4)交易执行

集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5)投资绩效评估

数量分析师定期或不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整投资组合。

1)不定期的,基金经理对基金出现的较大的跟踪偏离进行及时分解和分析;

2)每周末,数量分析师对本基金的运行情况进行量化评估;

3)每季末,基金经理根据评估报告分析当季的投资操作和跟踪指数的偏离情况,主要对组合跟踪偏离和跟踪误差、现金控制情况、成份股更新期的投资操作以及成份股未来可能发生的变化进行分析并提供相关报告,作为今后投资运作的参考依据。

在正常市场情况下, 本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致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、跟踪误差进一步扩大。

(6)投资核对与监督

基金营运部基金会计通过交易数据的核对,对当日交易操作进行复核,如发现有违反《证券法》、《基金法》、基金合同、公司相关管理制度的交易操作,须立刻向投资总监汇报,并同时通报督察长、稽核监察部及基金经理。

集中交易室负责对基金投资的日常交易行为进行实时监控。

督察长和稽核监察部对投资决策和投资执行的过程进行合规性监督检查,有权调阅任何数据和资料,防止在投资管理过程中的违规风险。

(7)组合监控与调整

基金经理将跟踪标的指数变动, 结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

(8)投资风险管理

投资风险管理是基金投资管理的重要环节,公司根据投资决策的不同层次建立完善的基金风险控制系统。

基金投资风险管理包括对投资合规性风险的管理以及对投资组合风险的管理:

1)公司董事会下属风险管理委员会、公司督察长定期不定期对公司投资管理制度、投资决策程序的合法性、合规性、有效性及基金运作过程中的合法性、合规性进行全面检查评价,如发现问题,应责成公司相关部门提出改进方案并落实。

2)风险管理委员会和金融工程部通过审议本基金的投资运作季报,以及对日常投资的跟踪监控,从而控制本基金的投资组合风险。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整,并在基金招募说明书及其更新中公告。

(四)投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产的90%;

(2)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(3)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;

(4)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

(6)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(7)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(9)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(10)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(11)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

(12)本基金从事股票指数期货投资时,遵循相关法律法规的规定:本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的100%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的20%; 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%; 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;

(13)本基金主动投资流动性受限资产的市值合计不得超过本基金基金资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述投资比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资,法律法规另有规定的,从其规定;

(14)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手方开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致;

(15)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(9)、(13)、(14)项外,因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(8)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数变更的, 相应更换基金名称和业绩比较基准,并在报中国证监会备案后及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金, 主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

十一、基金的投资组合报告

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。

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2020年03月26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。

本报告期自2019年01月01日起至12月31日止。

§1 投资组合报告

1.1 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	32,136,012.34	95.34
	其中:股票	32,136,012.34	95.34
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	1,567,672.89	4.65
8	其他各项资产	1,472.87	0.00
9	合计	33,705,158.10	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 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	–	–
C	制造业	–	–
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	–	–
J	金融业	27,516,266.26	85.44
K	房地产业	4,619,746.08	14.34
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	32,136,012.34	99.78

1.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

1.2.3 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有港股通投资股票。

1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

1.3.1 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	601318	中国平安	61,486	5,254,593.56	16.32
2	600036	招商银行	58,099	2,183,360.42	6.78
3	601166	兴业银行	82,358	1,630,688.40	5.06
4	600030	中信证券	44,549	1,127,089.70	3.50
5	000002	万科A	33,331	1,072,591.58	3.33
6	000001	平安银行	54,958	904,059.10	2.81
7	600016	民生银行	140,970	889,520.70	2.76
8	601328	交通银行	156,237	879,614.31	2.73
9	600000	浦发银行	66,680	824,831.60	2.56
10	601288	农业银行	217,976	804,331.44	2.50
11	601398	工商银行	121,782	716,078.16	2.22
12	600837	海通证券	46,019	711,453.74	2.21
13	601601	中国太保	17,896	677,184.64	2.10
14	600048	保利地产	40,975	662,975.50	2.06
15	601688	华泰证券	25,170	511,202.70	1.59
16	300059	东方财富	30,300	477,831.00	1.48
17	601169	北京银行	83,994	477,085.92	1.48
18	601211	国泰君安	25,750	476,117.50	1.48
19	002142	宁波银行	15,781	444,235.15	1.38
20	601988	中国银行	119,700	441,693.00	1.37
21	601818	光大银行	90,315	398,289.15	1.24
22	601229	上海银行	40,611	385,398.39	1.20
23	600919	江苏银行	52,400	379,376.00	1.18
24	001979	招商蛇口	18,040	358,454.80	1.11
25	601628	中国人寿	9,344	325,825.28	1.01
26	600999	招商证券	16,072	293,956.88	0.91
27	601009	南京银行	33,460	293,444.20	0.91
28	601939	建设银行	38,039	275,021.97	0.85
29	600015	华夏银行	34,894	267,636.98	0.83
30	000166	申万宏源	51,438	263,362.56	0.82
31	000776	广发证券	16,710	253,490.70	0.79
32	601336	新华保险	4,933	242,456.95	0.75
33	600958	东方证券	20,100	216,276.00	0.67
34	601155	新城控股	5,306	205,448.32	0.64
35	601901	方正证券	23,235	201,447.45	0.63
36	600340	华夏幸福	6,855	196,738.50	0.61
37	601377	兴业证券	26,442	187,209.36	0.58
38	600383	金地集团	12,614	182,903.00	0.57
39	000069	华侨城A	23,100	179,949.00	0.56
40	002736	国信证券	13,944	174,997.20	0.54
41	601108	财通证券	14,300	162,162.00	0.50
42	000783	长江证券	22,107	157,843.98	0.49
43	600705	中航资本	30,418	147,527.30	0.46
44	601099	太平洋	38,700	146,673.00	0.46
45	601788	光大证券	11,136	145,881.60	0.45
46	601128	常熟银行	15,800	143,938.00	0.45
47	600606	绿地控股	20,700	143,865.00	0.45
48	600061	国投资本	9,500	143,830.00	0.45
49	601997	贵阳银行	14,700	140,532.00	0.44
50	601555	东吴证券	13,546	135,324.54	0.42
51	600109	国金证券	13,710	127,503.00	0.40
52	600926	杭州银行	12,280	112,484.80	0.35
53	000961	中南建设	10,500	110,775.00	0.34
54	000728	国元证券	11,608	107,606.16	0.33
55	601998	中信银行	17,400	107,358.00	0.33
56	601198	东兴证券	7,900	103,806.00	0.32
57	002797	第一创业	12,140	100,519.20	0.31
58	002673	西部证券	9,857	96,598.60	0.30
59	002146	荣盛发展	9,708	95,429.64	0.30
60	000656	金科股份	12,357	94,901.76	0.29
61	601838	成都银行	10,200	92,514.00	0.29
62	600208	新湖中宝	24,289	91,812.42	0.29
63	000750	国海证券	16,660	88,964.40	0.28
64	601881	中国银河	7,400	85,914.00	0.27
65	601878	浙商证券	7,600	84,588.00	0.26
66	002926	华西证券	7,500	82,575.00	0.26
67	600369	西南证券	15,788	81,939.72	0.25
68	000671	阳光城	9,625	81,812.50	0.25
69	000627	天茂集团	11,300	79,552.00	0.25
70	600325	华发股份	10,104	79,114.32	0.25
71	002500	山西证券	9,528	78,987.12	0.25
72	000686	东北证券	8,074	75,088.20	0.23
73	000909	华安证券	10,200	74,460.00	0.23
74	601066	中信建投	2,400	72,960.00	0.23
75	600663	陆家嘴	5,300	71,603.00	0.22
76	600895	张江高科	4,662	71,375.22	0.22
77	600466	蓝光发展	9,100	67,067.00	0.21
78	002670	国盛金控	5,274	67,032.54	0.21
79	600376	首开股份	7,667	61,105.99	0.19
80	002807	江阴银行	12,580	58,622.80	0.18
81	600816	安信信托	13,098	58,155.12	0.18
82	000402	金融街	7,111	57,741.32	0.18
83	600155	华创阳安	4,000	56,120.00	0.17
84	600094	大名城	9,500	55,575.00	0.17
85	600266	北京城建	6,680	54,108.00	0.17
86	601577	长沙银行	5,700	51,699.00	0.16
87	600643	爱建集团	5,337	51,235.20	0.16
88	600064	南京高科	5,210	50,797.50	0.16
89	000031	大悦城	7,006	50,303.08	0.16
90	000563	陕国投A	11,329	50,187.47	0.16
91	600848	上海临港	2,000	49,100.00	0.15
92	002936	郑州银行	9,900	46,035.00	0.14
93	601319	中国人保	5,900	44,781.00	0.14
94	600649	城投控股	7,567	43,283.24	0.13
95	600823	世茂股份	9,400	42,300.00	0.13
96	600515	海航基础	9,300	41,478.00	0.13
97	600908	无锡银行	7,400	41,070.00	0.13
98	600158	中体产业	4,000	40,120.00	0.12
99	000712	锦龙股份	2,400	36,480.00	0.11
100	000718	苏宁环球	9,500	36,290.00	0.11
101	000732	泰禾集团	5,900	36,285.00	0.11
102	600748	上实发展	5,982	35,533.08	0.11
103	601236	红塔证券	2,100	35,217.00	0.11
104	002244	滨江集团	7,044	34,656.48	0.11
105	002839	张家港行	5,800	34,452.00	0.11
106	600901	江苏租赁	5,300	33,496.00	0.10
107	002939	长城证券	2,400	33,264.00	0.10
108	600291	西水股份	3,700	33,263.00	0.10
109	600565	迪马股份	8,800	31,504.00	0.10
110	000987	越秀金控	3,100	29,977.00	0.09
111	000006	深振业A	5,577	29,892.72	0.09
112	600639	浦东金桥	2,200	29,700.00	0.09
113	002945	华林证券	1,900	28,386.00	0.09
114	002285	世联行	7,256	27,210.00	0.08
115	601162	天风证券	3,500	25,760.00	0.08
116	000537	广宇发展	3,300	25,641.00	0.08
117	600053	九鼎投资	1,000	25,430.00	0.08
118	002958	青农商行	3,500	22,645.00	0.07
119	600390	五矿资本	2,740	22,632.40	0.07
120	600928	西安银行	2,700	20,979.00	0.07
121	600657	信达地产	5,089	20,305.11	0.06
122	002948	青岛银行	3,300	19,602.00	0.06
123	601860	紫金银行	2,100	11,802.00	0.04
124	002423	中粮资本	1,200	11,652.00	0.04

1.3.2 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

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.4.1 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	601318	中国平安	1,143,771.00	4.86
2	601988	中国银行	573,658.00	2.44
3	300059	东方财富	528,660.00	2.25
4	601166	兴业银行	498,927.00	2.12
5	600036	招商银行	399,711.00	1.70
6	600958	东方证券	249,169.00	1.06
7	600030	中信证券	206,607.00	0.88
8	601108	财通证券	206,430.00	0.88
9	601688	华泰证券	202,773.00	0.86
10	601997	贵阳银行	174,590.00	0.74
11	601099	太平洋	167,957.00	0.71
12	000002	万科A	167,724.00	0.71
13	601328	交通银行	154,460.00	0.66
14	600919	江苏银行	146,302.00	0.62
15	600016	民生银行	145,768.00	0.62
16	601066	中信建投	142,792.00	0.61
17	601998	中信银行	133,978.00	0.57
18	601601	中国太保	133,797.00	0.57
19	601288	农业银行	133,137.00	0.57
20	600000	浦发银行	128,699.00	0.55

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。

1.4.2 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	601318	中国平安	965,399.00	4.11
2	601988	中国银行	565,009.32	2.40
3	600036	招商银行	394,577.00	1.68
4	601166	兴业银行	239,021.00	1.02
5	600030	中信证券	165,592.00	0.70
6	601328	交通银行	149,447.00	0.64
7	600340	华夏幸福	143,072.00	0.61
8	600016	民生银行	137,723.00	0.59
9	601997	贵阳银行	135,909.00	0.58
10	601998	中信银行	132,338.80	0.56
11	601601	中国太保	124,179.00	0.53
12	601288	农业银行	119,765.00	0.51
13	600000	浦发银行	119,662.00	0.51
14	601398	工商银行	116,230.00	0.49
15	600837	海通证券	114,629.00	0.49
16	000540	中天金融	92,016.00	0.39
17	601211	国泰君安	91,696.00	0.39
18	601336	新华保险	85,353.00	0.36
19	601155	新城控股	83,918.00	0.36
20	600048	保利地产	83,821.00	0.36

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。

1.4.3 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	9,488,042.00
卖出股票收入(成交)总额	6,511,798.98

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。

1.5 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。

1.6 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。

1.7 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。

1.8 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。

1.9 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。

1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

1.11 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。

1.12 投资组合报告附注

1.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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。

1.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

1.12.3 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	1,286.46
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	186.41
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,472.87

1.12.4 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。

1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1.12.5.1 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。

1.12.5.2 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不存在流通受限的情况。

十二、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险, 投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

阶段	净值增长率(1)	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)
2013年8月23日(基金合同生效日)至2013年12月31日	–11.40%	1.24%	1.13%	1.51%	–12.53%	–0.27%
2014年1月1日至2014年12月31日	88.18%	1.61%	84.95%	1.62%	3.23%	–0.01%
2015年1月1日至2015年12月31日	–2.82%	2.53%	–3.35%	2.56%	0.53%	–0.03%
2016年1月1日至2016年12月31日	–10.22%	1.31%	–10.70%	1.30%	0.48%	0.01%
2017年1月1日至2017年12月31日	16.53%	0.75%	15.72%	0.76%	0.81%	–0.01%
2018年1月1日至2018年12月31日	–19.94%	1.43%	–21.03%	1.43%	1.09%	0.00%
2019年1月1日至2019年12月31日	33.11%	1.36%	32.71%	1.37%	0.40%	–0.01%
2013年8月23日(基金合同生效日)至2019年12月31日	80.65%	1.57%	95.79%	1.59%	–15.14%	–0.02%

(二) 自基金合同生效以来基金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图

十三、基金的费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金的标的指数使用许可费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金上市费及年费;

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times 0.5\%\div$ 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。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书, 于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times 0.1\%\div$ 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书, 于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、基金的标的指数使用许可费

基金的标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times$ 标的指数使用许可费年费率 $\div$ 当年天数,根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定,本基金标的指数使用许可费年费率为0.03%。

H为每日应计提的基金标的指数使用许可费

E为前一日基金资产净值

标的指数使用许可费每日计算,逐日累计,按季支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数使用许可费划付指令,经基金托管人复核后于每年1月、4月、7月、10月的前十个工作日内将上季度标的指数使用许可费从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

标的指数使用许可费的收取下限为每季度人民币50000元, 若计费期间不足一季度的,则根据实际天数按比例计算该计费期间的收取下限。若当季已计提的标的指数使用许可费累计未达到该计费期间的收取下限,则在当季末一次性补提差额部分。

基金管理人可根据指数许可使用合同和基金份额持有人的利益,对上述计提方式进行合理变更并公告。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数使用许可费费率和计费方式,基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前2日在指定媒介上刊登公告。

上述"一、基金费用的种类中第4–9项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

一、对基金《更新招募说明书》中的重要提示、基金管理人、基金的投资、基金的业绩、其他应披露事项章节进行更新。

二、对基金《更新招募说明书摘要》中的重要提示、基金管理人、基金的名称、基金的投资、基金的业绩章节进行更新。

汇添富基金管理股份有限公司

2020年4月15日