中证800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5月7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:平安银行股份有限公司
重要提示

中证800交易型开放式指数证券投资基金（基金简称：添富中证800ETF；证券简称：800ETF；扩位证券简称:800ETF;证券代码:515800;申购赎回代码:515801;以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会证监许可【2019】162号文注册，进行募集。本基金基金合同于2019年10月8日正式生效。

基金管理人保证（中证800交易型开放式指数证券投资基金招募说明书）(以下简称"招募说明书"或"本招募说明书")的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括:因政治、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。同时由于本基金是交易型开放式指数证券投资基金,特定风险还包括:标的指数的风险,基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险,基金交易价格与份额净值发生偏离的风险,参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险,退补现金替代方式的风险,赎回对价的变现风险等等。本基金的投资范围包括中小企业私募债券,资产支持证券,金融衍生品。中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债券的风险主要包括信用风险,流动性风险,市场风险等,资产支持证券的投资风险主要包括信用风险、利率风险、流动性风险,提前偿付风险、操作风险和法律风险等。金融衍生品是一种金融合约,其价值取决于一种或多种基础资产或指数,其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品的风险主要包括市场风险,信用风险、流动性风险,操作风险和法律风险等。

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。

投资者申购的基金份额当日起可卖出,投资者赎回获得的股票当日起可卖出。

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。

投资有风险,投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》、《基金合同》,基金产品资料概要等信息披露文件,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等情况判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应,且independently判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

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,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

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导致的投资风险,由投资者自行负担。

本次招募说明书主要涉及标的指数使用许可费相关内容的更新,本招募说明书更新截止日为2020年5月7日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年12月31日。

第一部分、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%
上海上投资产管理有限公司	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,东方证券股份有限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。

程越先生,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。现任上海投业集团副总经理,上海上投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,上海陆家嘴投资发展有限公司董事长,上海国有资本经营有限公司董事。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,上海国际集团资金融资有限公司党委书记、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党委书记、副总经理。

张辉先生,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。历任中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处长，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,厦门大学经济学院副主任会计师,副教授,伊利诺伊大学香槟分校(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,《凌士堂》等栏目资深评论员。2002—2003年期间受邀成为约翰·查普金斯大学访问学者。

魏苟进（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

任瑞昌先生,2004年10月20日担任监事,2015年4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。现任上海投业集团上海上投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。

王如丽先生,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。历任中银万国证券万国证券计划财务总部经理专员、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4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,中南财经政法大学工商管理硕士。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)

张辉先生,2015年4月25日担任总经理。(简历请参见上述董事会成员介绍)

崔晓明先生，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,中国证券报证券有限责任公司营业部总经理,总经业务总监,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。

娄森文先生，2013年1月7日担任副总经理，国籍:中国,金融经济学硕士。曾在麻省国际信托投资有限公司,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嘉达基金北京与上海代表处工作,负责投资研究、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。历任中国银行计算机处副处长,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副总经理兼北京研发中心主任、信息技术管理部副总经理(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,上海农商银行可转债金融部副总经理,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

过倍俊女士,国籍:中国,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。曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理总经理,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,现任基金经理助理,2015年8月31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医药指数(LOF)基金的基金经理,2017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300ETF基金的基金经理。

朱志宏女士，国籍:中国,复旦大学经济学硕士,6年证券从业经验。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日至今任添富中证银行ETF联接基金的基金经理,2019年7月26日至今任添富中证长三角ETF的基金经理,2019年10月8日至今任添富中证800ETF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。

第二部分、基金托管人

名称:平安银行股份有限公司
注册住所:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址:广东省深圳市福田区益田路5023号
法定代表人:谢永林
成立日期:1987年12月22日
组织形式:股份有限公司
注册资本:19,405,918,198元
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监许可[2008]1037 号
联系人:蒋希晨
联系电话:(0755) 2219 7701
1.平安银行基本情况

平安银行股份有限公司是一家总部设在深圳的全国性股份制商业银行（深圳证券交易所简称：平安银行,证券代码000001）。其前身是深圳发展银行股份有限公司,于2012年6月吸收合并原平安银行并于同年7月更名为平安银行。中国平安保险(集团)股份有限公司及其子公司合计持有平安银行58%的股份,为平安银行的控股股东。截至2019年末,平安银行有91家分行（含香港分行）,共1,058家营业机构。

2019年,平安银行实现营业收入1379.58亿元(同比增长18.2%),净利润 281.95亿元（同比增长 13.6%）,资产总额 39,390.70亿元(较上年末增长15.2 %)，吸收存款余额24,369.35亿元(较上年末增长 14.5%)，发放贷款和垫款总额(含贴现)23,232.06亿元(较上年末增长 16.3%)。

平安银行总行设资产托管事业部,下设市场拓展处、创新发展处、估值核算处、资金清算处、规划发展处、IT系统支持处、督察合规处、基金服务中心8 个处室,目前部门人员为60人。

第三部分、相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、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。

2、二级市场交易代理券商

本基金沪深二级市场交易业务的销售机构为具有基金销售业务资格、经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位。具体会员单位名单可在上海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:周明
联系电话:010-58598839
传真:010-58598907
联系人:朱立元

三、出具法律意见书的律师事务所

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:黎明、陈颖华
联系人:陈颖华

四、审计基金财产的会计师事务所

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:毛数宁
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

第四部分、基金的名称

本基金名称:中证800交易型开放式指数证券投资基金
基金简称:添富中证800ETF
证券简称:800ETF
扩位证券简称:800ETF
证券代码（二级市场交易代码）:515800
申购赎回代码:515801

第五部分、基金的类型

本基金为交易型开放式证券投资基金。

第六部分、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的最小化。

第七部分、基金的投资方向

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,本基金可少量投资于非成分股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）,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、中小企业私募债券、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、权证、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的相关规定）。

在条件许可可的情况下,基金管理人可在不突破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。

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。

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%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

第八部分、基金的投资策略

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。

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。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%。在跟踪误差不超过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。

1、资产配置策略

本基金管理人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。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%,股指期货、权证、国债期货、股票期权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。

2、债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响,进行合理的利率预期,判断债券市场的基本走势,制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中,本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场利差、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、资产组合管理等管理手段进行个券选择。本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,降低跟踪误差。

本基金将在严格控制信用风险的基础上,通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券,对其投资策略以持有到期为主,在综合考虑债券信用资质、债券收益率和期限的前提下,重点选择资质较好、收益率较好的中小企业私募债券进行投资。

3、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上,对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策。

4、金融衍生工具投资策略

本基金将基于遵循原则运用股指期货、权证、国债期货、股票期权等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以控制并降低投资组合风险、提高投资效率,降低跟踪误差,从而更好地实现本基金的投资目标。

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。

本基金将通过对权证标的证券的基本面进行研究,结合多种定价模型和投资策略,根据基金资产组合情况适度进行权证的投资。

本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征,在风险可控的基础上,以套期保值为目的,参与国债期货的投资,以降低跟踪误差。

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关规定和要求,确定参与股票期权交易的投资目标和投资比例。

5、融资及转融通投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上,审慎参与融资及转融通交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析,确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务法律法规发生变化,本基金将从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

未来,随着投资工具的发展和丰富,本基金可在不改变投资目标的前提下,相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明更新中公告。

第九部分、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数收益率,即中证800指数收益率。

中证800指数由中证指数有限公司发布。如果指数编制单位变更或终止标的指数的编制、发布或授权,或上述标的指数出现或者可能出现重大调整等情况,或由于指数编制方法的重大变更等事项导致上述指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,基金管理人认为有必要作相应调整时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。届时,若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

第十部分、基金的风险收益特征

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。

第十一部分、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。

基金托管人平安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10月08日（基金合同生效日）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	4,639,350,599.66	91.81
	其中:股票	4,639,350,599.66	91.81
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	624,900.00	0.01
	其中:债券	624,900.00	0.01
	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	329,818,067.32	6.53
8	其他各项资产	83,506,053.84	1.65
9	合计	5,053,299,620.82	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按申购赎回代理券商股票投资组合

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	56,872,558.16	1.14
B	采矿业	131,851,196.00	2.64
C	制造业	2,215,359,563.75	44.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	106,093,725.00	2.13
E	建筑业	100,426,601.00	2.01
F	批发和零售业	75,507,149.00	1.51
G	交通运输、仓储和邮政业	129,500,413.00	2.60
H	住宿和餐饮业	3,536,937.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	187,040,537.00	3.75
J	金融业	1,264,654,757.10	25.37
K	房地产业	192,726,847.00	3.87
L	租赁和商务服务业	55,241,530.00	1.11
M	科学研究和技术服务业	21,874,496.80	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	9,296,424.00	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	3,912,924.00	0.08
Q	卫生和社会工作	38,533,933.88	0.77
R	文化、体育和娱乐业	33,827,948.00	0.68
S	综合	8,116,864.00	0.16
	合计	4,634,374,394.69	92.96

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

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	215,279.55	0.00
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	205,887.00	0.00
J	金融业	4,548,460.38	0.09
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	6,578.04	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	4,976,204.97	0.10

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持有港股通投资股票投资组合。

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	3,238,456	276,758,449.76	5.55
2	601212	白银有色	74,042,600	272,476,768.00	5.47
3	600519	贵州茅台	128,903	152,402,249.00	3.06
4	600036	招商银行	2,640,200	99,218,716.00	1.99
5	000651	格力电器	1,232,474	80,825,644.92	1.62
6	601166	兴业银行	3,723,200	73,719,360.00	1.48
7	000333	美的集团	1,242,961	72,402,478.25	1.45
8	600276	恒瑞医药	792,388	69,349,797.76	1.39
9	000858	五粮液	497,765	66,207,722.65	1.33
10	600030	中信证券	2,014,100	50,956,730.00	1.02
11	600887	伊利股份	1,559,600	48,254,024.00	0.97
12	000002	万科A	1,494,200	48,083,356.00	0.96
13	600900	长江电力	2,252,600	41,402,788.00	0.83
14	000001	平安银行	2,483,467	40,853,032.15	0.82
15	600016	民生银行	6,356,600	40,110,146.00	0.80
16	601328	交通银行	7,031,100	39,585,093.00	0.79
17	600000	浦发银行	3,005,600	37,179,272.00	0.75
18	601288	农业银行	9,803,600	36,175,284.00	0.73
19	601398	工商银行	5,518,400	32,448,192.00	0.65
20	300498	温氏股份	563,800	32,047,680.00	0.64
21	600837	海通证券	2,071,300	32,022,296.00	0.64
22	002415	海康威视	967,300	31,342,002.00	0.63
23	601601	中国太保	805,000	30,461,200.00	0.61
24	601668	中国建筑	5,368,800	30,172,656.00	0.61
25	002475	立讯精密	822,800	30,032,200.00	0.60
26	600048	保利地产	1,833,700	29,669,266.00	0.60
27	600585	海螺水泥	512,900	28,106,920.00	0.56
28	000725	京东方A	6,065,600	27,537,824.00	0.55
29	600031	三一重工	1,509,200	25,731,860.00	0.52
30	601688	华泰证券	1,128,900	22,927,959.00	0.46
31	600309	万华化学	403,100	22,642,127.00	0.45
32	601888	中国国旅	250,400	22,273,080.00	0.45
33	603288	海天味业	206,900	22,243,819.00	0.45
34	300059	东方财富	1,376,900	21,713,713.00	0.44
35	000063	中兴通讯	610,100	21,591,439.00	0.43
36	601169	北京银行	3,788,400	21,518,112.00	0.43
37	600104	上汽集团	896,200	21,374,370.00	0.43
38	601211	国泰君安	1,154,600	21,348,154.00	0.43
39	002142	宁波银行	721,700	20,315,855.00	0.41
40	601988	中国银行	5,398,500	19,920,465.00	0.40
41	002714	牧原股份	221,604	19,676,219.16	0.39
42	000338	潍柴动力	1,225,800	19,465,704.00	0.39
43	600009	上海机场	247,000	19,451,250.00	0.39
44	600690	海尔智家	943,900	18,406,050.00	0.37
45	601818	光大银行	4,078,400	17,985,744.00	0.36
46	601766	中国中车	2,492,700	17,805,018.00	0.36
47	600028	中国石化	3,425,400	17,503,794.00	0.35
48	601229	上海银行	1,818,500	17,257,565.00	0.35
49	603259	药明康德	186,840	17,211,700.80	0.35
50	002304	洋河股份	155,100	17,138,550.00	0.34
51	600919	江苏银行	2,366,300	17,132,012.00	0.34
52	601012	隆基股份	675,600	16,775,148.00	0.34
53	002027	分众传媒	2,636,000	16,501,360.00	0.33
54	000661	长春高新	36,600	16,360,200.00	0.33
55	000568	泸州老窖	186,600	16,174,488.00	0.32
56	601899	紫金矿业	3,522,000	16,165,980.00	0.32
57	601979	招商蛇口	811,900	16,132,453.00	0.32
58	000100	TCL科技	3,471,100	15,515,817.00	0.31
59	601088	中国神华	846,500	15,448,625.00	0.31
60	601628	中国人寿	426,313	14,865,534.31	0.30
61	601857	中国石油	2,484,300	14,483,469.00	0.29
62	600050	中国联通	2,384,400	14,044,116.00	0.28
63	002230	科大讯飞	395,300	13,629,944.00	0.27
64	600999	招商证券	734,000	13,424,860.00	0.27
65	601009	南京银行	1,522,500	13,352,325.00	0.26
66	600019	宝钢股份	2,278,000	13,075,720.00	0.26
67	600570	恒生电子	165,700	12,879,861.00	0.26
68	600406	国电南瑞	591,500	12,527,970.00	0.25
69	601006	大秦铁路	1,525,200	12,521,892.00	0.25
70	300015	爱尔眼科	316,473	12,519,671.88	0.25
71	601939	建设银行	1,721,100	12,443,553.00	0.25
72	601390	中国中铁	2,088,800	12,407,472.00	0.25
73	601989	中国重工	2,342,800	12,276,272.00	0.24
74	600015	华夏银行	1,577,300	12,097,891.00	0.24
75	601186	中国铁建	1,176,700	11,931,738.00	0.24
76	000166	申万宏源	2,313,300	11,844,096.00	0.24
77	000538	云南白药	131,500	11,760,045.00	0.24
78	002241	歌尔股份	582,900	11,611,368.00	0.23
79	600703	三安光电	627,200	11,515,392.00	0.23
80	000776	广发证券	755,600	11,462,452.00	0.23
81	002594	比亚迪	232,000	11,059,440.00	0.22
82	000876	新希望	538,300	10,739,085.00	0.22
83	002044	美年健康	704,900	10,496,961.00	0.21
84	600741	华域汽车	403,100	10,476,569.00	0.21
85	601336	新华保险	212,900	10,464,035.00	0.21
86	603986	兆易创新	50,400	10,326,456.00	0.21
87	300142	沃森生物	314,800	10,212,112.00	0.20
88	600958	东方证券	917,400	9,871,224.00	0.20
89	600362	江西铜业	666,700	9,647,149.00	0.19
90	002024	苏宁易购	963,600	9,640,896.00	0.19
91	601225	陕西煤业	1,022,600	9,193,174.00	0.18
92	002236	大华