

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：中国农业银行股份有限公司													
重要提示													
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（基金简称：添富中证国企一带一路ETF； 证券简称：添富国企； 证券简称：国企一带一路ETF； 证券代码：515990； 申购赎回代码：515991； 以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2019】1244号文注册，进行募集。 本基金基金合同于2019年11月6日正式生效。													
基金管理人保证《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人风险。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、基金替代交易方式份额净值存在偏离的风险、参与IOPV决策和IOPV计算错误的风险、退补现金替代数据与IOPV数据、赎回对价的变现风险等。													
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，不同销售机构的风险产品“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校验。													
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。													
投资者有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的基金合同、基金招募说明书、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、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，自主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。													
本招募说明书中涉及财务数据和净值表现内容的更新，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2020年3月31日。													
一、基金管理人简介													
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]15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：													
<table><tr><th>股东名称</th><th>股权比例</th></tr><tr><td>东方证券股份有限公司</td><td>35.412%</td></tr><tr><td>上海聚宝投资管理合伙企业(有限合伙)</td><td>24.656%</td></tr><tr><td>上海上投资产管理股份有限公司</td><td>19.906%</td></tr><tr><td>东航证券有限责任公司</td><td>19.906%</td></tr><tr><td>合计</td><td>100%</td></tr></table>		股东名称	股权比例	东方证券股份有限公司	35.412%	上海聚宝投资管理合伙企业(有限合伙)	24.656%	上海上投资产管理股份有限公司	19.906%	东航证券有限责任公司	19.906%	合计	100%
股东名称	股权比例												
东方证券股份有限公司	35.412%												
上海聚宝投资管理合伙企业(有限合伙)	24.656%												
上海上投资产管理股份有限公司	19.906%												
东航证券有限责任公司	19.906%												
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，中国人民银行吉林支行、国家外汇管理局吉林支行副行长、副局长，中国人民银行厦门市中心支行银行管理一处、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，上海东方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出口处副处长，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、上海国际集团金融办公室、信息中心主任，上海国际集团有限公司行政管理中心总经理，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。现任东航航空科技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，东航航空有限责任公司党委书记、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，曾担任中国证监会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会计划财务处会计，五大国际会计师事务所Touche Ross International(现为德勤)加拿大多个分支机构审计员，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)国际会计专业与研究中心访问学者，美国斯坦福大学(Stanford University)经济学院访问学者，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。													
杨善青女士，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投资产管理有限公司副总经理。历任文汇报新民联合报业集团财务中心财务主管、文汇报联合报业集团新闻投资公司财务主管、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、发展计划部办公室专员，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监管战略研究部、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。 现任东航航空科技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，东航航空科技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9日担任职工监事，国籍：中国，北京大学哲学博士。 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月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。													
姜淼女士，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信达证券股份有限公司与上海外代企业工作，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、投资决策委员会主席。													
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业委员。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。													
李骏先生，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有限公司，现任汇添富基金管理有限公司副总经理、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有限公司督察长。

4. 基金经理
吴振翔先生，国籍：中国，中国科学技术大学管理学博士，14年证券从业经验。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5日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011年9月16日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金的基金经理，2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理，2013年8月23日至2015年11月2日任中证主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金的基金经理，2013年11月6日至今任汇添富沪深300安心指数基金的基金经理，2015年2月16日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理，2015年3月24日至今任汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理，2016年1月21日至今任汇添富中证精准医药指数基金的基金经理，2016年7月28日至今任中证上海国企ETF的基金经理，2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数（LOF）的基金经理，2017年8月10日至今任汇添富中证500指数（LOF）的基金经理，2018年3月23日至今任添富价值多因子股票的基金经理，2019年7月26日至今任添富中证长三角ETF的基金经理，2019年9月24日至今任汇添富中证长三角ETF联接的基金经理，2019年11月6日任添富中证国企一带一路ETF的基金经理，2020年3月5日任添富中证国企一带一路ETF联接基金的基金经理。
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）、苏杰男（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
1. 基本情况
名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人：周慕冰
成立时间：2009年1月15日
批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]113号
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号
注册资本：34,998,303.4万元人民币
存续期间：持续经营
联系电话：010-66060609
传真：010-68121816
联系人：贺倩
中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点及员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务种类最多、服务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持稳健诚信经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。
中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”奖；2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”奖；2019年荣获证券时报授予的“2019年度资产托管银行天天”称号。
- 中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防盜设施和基金托管业务系统。
2. 主要人员情况
中国农业银行托管业务部现有员工近310名，其中具有高级职称的专家60名，服务团队成员专业水平高、业务素质好，服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。
3. 基金托管业务经营情况
截止到2019年12月31日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共488只。

- 三、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) 31359666
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：毛鞍宁
电话：010-58153000
传真：010-58188298
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：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
- 基金简称：添富中证国企一带一路ETF
证券简称：添富国企
证券代码：添富国企
扩位 证券简称：国企一带一路ETF
证券代码（二级市场交易代码）：515990
申购赎回代码：515991
- 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的最小化。
- 七、基金的投资方向
本基金主要投资于标的指数的成份股、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）、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）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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：投资于标的指数的成份股和备选成份股的资产不得低于基金资产净值的90%，且不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。
如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人可在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

- 八、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）标的指数的成份股股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人目标的指数的跟踪误差或严重超标等。
- 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或其他原因，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%，且不低于非现金基金资产的90%，股指期货、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，制定中长期期的资产类别资产配置策略。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、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。本基金债券投资的目的在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。
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、金融衍生品工具投资策略
本基金基于谨慎原则运用股指期货、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限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。
5. 参与融资融券策略
本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资融券。本基金将基于对市场行情和组合风险提示的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资融券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。
6. 参与转融通证券出借业务策略
为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申购赎回情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。
- 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，并在招募说明书更新中公告。
- 九、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，即中证国企一带一路指数收益率。
中国国企一带一路指数由中证指数有限公司发布。如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或上述标的指数的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等原因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、更适合投资的其他指数，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。其中，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），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。
- 十、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。
- 十一、基金的投资组合报告
基金管理人董事会及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责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年04月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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2020年01月01日起至03月31日止。
§1 投资组合报告
1.1 报告期末基金投资组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,856,989,607.85	96.29
	其中：股票	2,856,989,607.85	96.29
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	109,276,975.06	3.68
8	其他资产	664,972.91	0.02
9	合计	2,966,267,585.82	100.00
- 1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
1.2.1 报告期末指数股权投资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	256,917,381.08	9.98
C	制造业	1,396,690,959.65	46.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	267,306,229.08	9.02
E	建筑业	539,189,400.68	18.19
F	批发和零售业	73,362,757.00	2.47
G	交通运输、仓储和邮政业	185,919,610.00	6.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	83,037,688.50	2.80
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	24,859,2159.00	0.84
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		2,856,272,294.92	96.36
- 1.2.2 报告期末非股权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	689,6162.64	0.02
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	19,147.31	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,552.98	0.00
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		717,312.93	0.02
- 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。
1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
1.3.1 报告期末指数股权投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601800	中国国航	13,375,800	110,418,108.00	3.73
2	600585	海螺水泥	1,494,000	82,319,400.00	2.78
3	601618	中国中冶	29,318,664	76,814,899.68	2.59
4	600019	宝钢股份	15,439,400	75,189,878.00	2.54
5	600897	伊泰股份	2,356,676	70,340,483.36	2.37
6	601088	中国神华	4,232,567	68,736,880.08	2.32
7	002415	海康威视	2,427,200	67,718,880.00	2.28
8	600104	上汽集团	3,264,900	66,930,450.00	2.26
9	600028	中国石化	14,814,800	65,629,564.00	2.21
10	601668	中国国航	12,172,300	64,148,021.00	2.16
- 1.3.2 报告期末非股权投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	688123	聚辰股份	6,660	331,801.20	0.01
2	688047	芯微集团	3,028	317,122.44	0.01
3	603949	雪龙集团	875	21,840.00	0.00
4	603363	和顺石油	689	19,147.31	0.00
5	300025	阿尔特	1,642	17,552.98	0.00
- 1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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）标的指数的成份股股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人目标的指数的跟踪误差或严重超标等。

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或其他原因，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%，且不低于非现金基金资产的90%，股指期货、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，制定中长期期的资产类别资产配置策略。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、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。本基金债券投资的目的在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。
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
本基金基于谨慎原则运用股指期货、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限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。
5. 参与融资融券策略
本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资融券。本基金将基于对市场行情和组合风险提示的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资融券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。
6. 参与转融通证券出借业务策略
为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申购赎回情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。
- 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，并在招募说明书更新中公告。
- 九、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，即中证国企一带一路指数收益率。
中国国企一带一路指数由中证指数有限公司发布。如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或上述标的指数的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等原因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、更适合投资的其他指数，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。其中，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），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。
- 十、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。
- 十一、基金的投资组合报告
基金管理人董事会及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责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年04月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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2020年01月01日起至03月31日止。
§1 投资组合报告
1.1 报告期末基金投资组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,856,989,607.85	96.29
	其中：股票	2,856,989,607.85	96.29
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	-	-