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 2024 年第 2 季度报告

2024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: 2024年07月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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2024年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024年 04月 01日起至 2024年 06月 30日止。

§2基金产品概况

2.1基金基本情况

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			
报告期末基金份额总额(份)	410, 941, 627. 00			
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪			
12页日你	误差的最小化。			
	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			
投资策略	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
	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
风险收益特征	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。
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

注: 扩位证券简称: 长三角 ETF。

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期(2024年04月01日 - 2024年06月30日)
1. 本期已实现收益	-18, 470, 143. 78
2. 本期利润	-10, 986, 307. 46
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0251
4. 期末基金资产净值	344, 909, 543. 74
5. 期末基金份额净值	0. 8393

- 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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,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, 计入费用后实际收益水平 要低于所列数字。

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	1)-3	2-4
过去三 个月	-3.21%	0.87%	-4.66%	0.88%	1. 45%	-0.01%
过去六 个月	-4.39%	1.10%	-5.85%	1.12%	1.46%	-0.02%
过去一 年	-14.85%	1.00%	-16.87%	1.01%	2. 02%	-0.01%
过去三	-37. 56%	1.11%	-42.01%	1.12%	4. 45%	-0.01%
自基金 合同生 效日起 至今	-16. 07%	1.18%	-20. 65%	1.20%	4. 58%	-0. 02%

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。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 4 管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基 任职日期	基金经理期限 离任日期	证券从业年限 (年)	说明
孙浩	本基金经理	2024年04月19日		4	国历融格金格历起管司20日中路指金金8中易证接理29富型券基理29银式基基年今一籍:硕:从CFA。2020百里易证接理2911年2911年2011年2011年2011年2011年2011年2011年

交易亚并投资基金经理,2023年11月28日至今任汇场的基金经理,2023年11月28日至今任汇国易易证券投资基金经理,20日至的工产,在11月28日,28日,20日至中证的对于,28日,20日至中证的新发。20日本中证的新发发表。2023年12日,28日,28日,28日,28日,28日,28日,28日,28日,28日,2			
联接基金的基金 经理。2023 年 11 月 28 日至今 住汇 7			交易型开放式指
经理。2023年11月28日至今任汇添富MSCI中国A50 互联应 MSCI中国A50 互联应式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023年11月28日至今任汇添加工产生的新501次交易型开放式基金的基金经理。2023年12月12日至全个经汇添富型开放资量。2023年12月12日至今任汇添富型开放或基金的基金经理。2023年12月12日至今任汇汇添高中证2000次到工作的基金经理。2024年1月3高中证2000次到工作。1月3高中证式指数证券投资基金的经理。2024年2月7日至今任汇添易型升投资基金的线理。2024年2月7日至今任汇添高上型数量的基金经理。2024年3月12日至证代到大政武者的基金经理。2024年3月12日至证代到大政武者的基金经理。2024年3月12日至证代到大政武者的基金经理。2024年3月12日至证代到大政武者的基金经理。2024年3月12日至证代到大政武者的基金经理。2024年3月12日至证代到大政武者数量是式证券投资基金的基金经过工证券投资基金的基金证券投资基金的基金经过工证券投资基金经过工证券投资基金经过工证券投资基金经过工证券投资基金经过工证券投资基金经过工证券投资基金证券投资基金经过工证券投资基金经过工证券投资基金			数证券投资基金
经理。2023年11月28日至今任汇添富MSCI中国A50 互联应 MSCI中国A50 互联应式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023年11月28日至今任汇添加工产生的新501次交易型开放式基金的基金经理。2023年12月12日至全个经汇添富型开放资量。2023年12月12日至今任汇添富型开放或基金的基金经理。2023年12月12日至今任汇汇添高中证2000次到工作的基金经理。2024年1月3高中证2000次到工作。1月3高中证式指数证券投资基金的经理。2024年2月7日至今任汇添易型升投资基金的线理。2024年2月7日至今任汇添高上型数量的基金经理。2024年3月12日至证代到大政武者的基金经理。2024年3月12日至证代到大政武者的基金经理。2024年3月12日至证代到大政武者的基金经理。2024年3月12日至证代到大政武者的基金经理。2024年3月12日至证代到大政武者的基金经理。2024年3月12日至证代到大政武者数量是式证券投资基金的基金经过工证券投资基金的基金证券投资基金的基金经过工证券投资基金经过工证券投资基金经过工证券投资基金经过工证券投资基金经过工证券投资基金经过工证券投资基金证券投资基金经过工证券投资基金经过工证券投资基金			联接基金的基金
11月28日至今 任汇添高MSCI 中国 450 互联互 通交数研数基金经理,2023年 1月深高中证创 新 50 交易型升 放式指金的基金经 理。2023年12月12日至今年 汇添岛型券投资理。2023年12月12日至今任 汇添局型券投理。2023年12月12日至公综合 交易证券金经理。2023年12月12日至公综合 交易证券金经理。2023年12月12日至公约指数要担 发展型,2024年1月2日至公理,2024年1月30亩中证红次易型升放资基金经理。2024年1月30亩中证红对交易型升放武指。数证券投资理。2024年2月7亩。1000交别证券投资基金的基金经理。2024年2月7亩。1000交别证券投资基金的基金经理。2024年3月12日至还证剩投资基金经理。2024年3月12日至证据数量是式证券投资基			经理。2023年
任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互 通交 对开放式 指数联互 经对开放式 指数联互 经的基 金经 型。2023 年 11 月 28 日 年 个 任汇添富 中证 的 新 50 次 数 型 开 放式 量 企 2023 年 12 月 12 日 至 今 任 汇添 是 2023 年 12 月 12 日 上 证 证 介			•
中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券基金的基金经理。2023 年 11 月 28 日中证沪 港湾江自主创新 50 省数的基金经理。2023 年 12 月 12 日至亚综大战 基金的 基本企业。2023 年 12 月 12 日至证综式指数证券投资理。2023 年 12 月 12 日至证 2000 全数 中证 2000 空易型开放式基金的基金经理。2024 年 1 月 30 日至公和 交易证券投资理。2024 年 1 月 30 日至公和 交易证券投联接基金的基金经理。2024 年 1 月 12 日至今任汇添富型投资基金的基金经理。2024 年 1 月 至今任汇添易型升放式基金发起基金经理。2024 年 1 月 至今任汇添当,以该基金的基金发起,2024 年 2 月 1 至今任汇添当,以该基金的基金发起,2024 年 3 月 12 日至今任汇添为量,2024 年 3 月 12 日本中和创版芯片,2024 年 3 月 12 日本中和创版工作,2024 年 3 月 2 日本中和创版工作和创版工作,2024 年 3 月 2 日本中和创版工作,2024 年 3 月 2 日本中和创版工作,2024 年 3 月 2 日本中和创版工作,2024 年 3 月 2 日本中和创版工作和工作和工作和工作和工作和工作和工作和工作和工作和工作和工作和工作和工作和工			
通交易型开放式 指数联接基金的基 金全理。2023年 11月28日至今 任汇深改交易型开 放式指的基金经理。2023年12月12日至今任 汇添合 交易证券经理。2023年12月12日至小 企员。2023年12月12日至小 企员或基金的基金经理。2023年12月12日至一 2023年12月12日至一 2023年12月12日至小 2023年12月12日至小 2024年1月30日至小 2024年1月30日至小 2024年1月30日至小 2024年1月7日至今任 汇添易型券投资基金的基金经理。2024年1月1日至今任 汇添易型数证基金经理。2024年1月1日至今任 汇添与型型发资或基金的基金经理。2024年1月1日至今任 汇添与型工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工			
指数证券投资基金经理。2023年11月28日至少任汇添富自主创新50交易型开放式指数证券投资基金经理。2023年12月12日至小企业,2023年2月12月12日至小企业,2023年2月12日至今任汇添高型产业,2023年2月12日至今任汇交易型开放资基金的基金经理。2024年1月30日至少利发基金的基金经理。2024年1月30日至少和大资基金的基金经理。2024年2月7日至今任汇次易型投资基金的基金经理。2024年2月7日至今任汇次易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年3月12日至今任汇添高上指数证券投资基金经理。2024年3月12日至今任汇添富上指数设基式证券投资基			
金联接基金的基金经理。2023年11月28日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年12月12日至今任汇添富上放资基金的基金经理。2023年12月12日至今任汇添富中证2000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年1月30日至少红河交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年2月7日至今任汇次易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年2月7日至今任汇次易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年2月1日至今任汇添易型,并放式指数证券投资基金的基金经理。2024年3月12日至小科创板芯片指数型发起式证券投资基			
金经理。2023年11月28日至今任汇添富中证沪港深张门自主创新50交易型开放式指数证基金经理。2023年12月12日至今任汇添易型开放资基金的基金经理。2023年12月12日至今任汇添易型开投资基金的基金经理。2023年12月12日至今任汇添易型开放式指数证券投资理。2024年1月30日至今任汇添富中证式指数证券投资基金的基金经理。2024年2月7日至今任汇添易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年2月7日至今任汇添易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年3月12日至今任汇添富人证券投资基处经理。2024年3月12日至今任汇添富人证券投资基			
11月28日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新50交易型开放式指数证基金经理。2023年12月12日至今任汇添富上证公约基金的基金经理。2023年12月12日至今任汇添富中证2000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年1月30日企业行为交易型开放式指数证产投资基金的基金发起式联发理。2024年2月7亩中证1000交易工产投资基金的基金经理。2024年2月7亩中证1000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年3月12日至今任汇添富上货投资基金的基金经理。2024年3月12日至今任汇添富上货投资基金的基金经理。2024年3月12日至今任汇添富上货投资基金经理。2024年3月12日至今任汇添富上货投资基处设置,2024年3月12日至今任汇添富上货投资基金经理。2024年3月12日至今任汇添富上货投资基			
任汇添富中证沪港深张江自主创新50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年12月12日至今任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年12月12日至今任汇添了基中证2000次易型开放或指数证券投资基金的基金经理。2024年1月30日至少任汇添别型开放或指数证券投资基金的基金发起式张疑理。2024年2月7日至今任汇添了基本的基金发起式。2024年2月7日至今任汇添基金的基金发起式。2024年2月7日至今任汇添基金的基金经理。2024年3月12日至今任汇添高上证券投资基金经理。2024年3月12日至今任汇添高上证券投资基金经理。2024年3月12日至今任汇添高上证券投资基			•
港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 12 日至今任汇添富上证或式指数证券投资理。2023 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 30 日至 4 年 1 月 30 日至 4 年 1 月 30 日至 4 年 2 月 7 日至今任汇添整基金的基金经理。2024 年 2 月 7 日至今任汇添贴中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 2 月 7 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数重求投资基金的基金经理。2024 年 3 月 12 百至今任汇添富上证料创板芯片指数型发起式证券投资基			
新50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年12 月12 日至今任汇添富上证综合交易型开放基金的基金金的基金经理。2023 年12 月12 日至今任汇添之。2023 年12 月12 日至今任汇添之。如此,这是是是一个人,这是一个人,这是一个一个人,这是一个人,这是一个一个一个人,这是一个人,这是一个一个人,这是一个人,这是一个人,这是一个人,这是一个一个人,这是一个一个人,这是一个一个人,这是一个人,这是一个人,这是一个一个人,这是一个人,这是一个一个人,这是一个一个人,这是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个			
放式指数证券投资基金的基金经理。2023年12月12日至今任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年12月12日至今任汇添富中证2000交易型开放式指数证券投资基金约基金经理。2024年1月30日至今任汇添高型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024年2月7日至今任汇添高量中证1000交易证开放式指数的基金经理。2024年2月7日至今任汇添高量,112日至今任汇添高量量,12日至今任汇添富上证料的板芯片指数型发起式证券投资基			, , ,
资基金的基金经理。2023年12月12日至今任 汇添富上证综合 交易型开放式指 数证券投资基金的基金经理。 2023年12月12日至今任汇交易 型开放式指数证 类投资基金经理。2024年 1月30日至今任 汇添易型开放式指 数证对关投资基金 发起式联接基金的基金经理。 2024年2月7日至今任汇添高中 证1000交易证 开放式指 数证券报表金经理。 2024年2月7日至今任汇添高中 证1000交易证券 投资基金经理。2024年3月12日至今任 汇添富上证科创 板芯片指数型发 起式证券投资基			
理。2023年12月12日至今任 汇添富上证综合 交易型开放式指 数证券投资基金的基金经理。 2023年12月12日至今任汇添富 中证 2000交易 型开放式指数证 券投资基金的基金经理。2024年 1月30日至今任 汇添富中证红利 交易型开放式指 数证券投资基金的基金 发起式联接基金的基金发起式联接基金的基金经理。 2024年2月7日 至今任汇添富中证1000交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2024年3月12日至今任 汇添富上证科的 板芯片指数型发 起式证券投资基			放式指数证券投
月 12 日至今任 汇添富上证综合 交易型开放式指 数证券投资基金 的基金经理。 2023 年 12 月 12 日至今任汇添富 中证 2000 交易 型开放式指数证 券投资基金的基 金经理。2024 年 1 月 30 日至今任 汇添富中证红利 交易型开放式指 数证券投资基金 的基金经理。 2024 年 2 月 7 日 至今任汇添富中 证 1000 交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2024 年 3 月 12 日至今任 汇添富上证科创 板芯片指数型发 起式证券投资基			资基金的基金经
汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2023 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 30 日至今任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2024 年 2 月 7 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 12 日至今任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基			理。2023年12
交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2023 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 30 日至今任汇添富中证约利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2024 年 2 月 7 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 12 日至今任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基			月 12 日至今任
数证券投资基金的基金经理。2023年12月12日至今任汇添富中证2000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年1月30日至今任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年2月7日至今任汇添富中证1000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年3月12日至今任汇添富上证料创板芯片指数型发起式证券投资基			汇添富上证综合
的基金经理。 2023 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 30 日至今任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金 的基金经理。2024 年 2 月 7 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 12 日至今任汇添富上证料创板芯片指数型发起式证券投资基			交易型开放式指
2023 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 30 日至今任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 2 月 7 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 12 日至今任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基			数证券投资基金
日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年1月30日至今任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024年2月7日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金 经理。2024年3月12日至今任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基			的基金经理。
中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年1月30日至今任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式张接基金的基金经理。2024年2月7日至今任汇添富中证1000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年3月12日至今任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基			2023年12月12
中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年1月30日至今任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式张接基金的基金经理。2024年2月7日至今任汇添富中证1000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年3月12日至今任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基			日至今任汇添富
型开放式指数证 券投资基金的基 金经理。2024年 1月30日至今任 汇添富中证红利 交易型开放式指 数证券投资基金 发起式联接基金 的基金经理。 2024年2月7日 至今任汇添富中 证1000交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2024年3 月12日至今任 汇添富上证科创 板芯片指数型发 起式证券投资基			
券投资基金的基金经理。2024年1月30日至今任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024年2月7日至今任汇添富中证1000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年3月12日至今任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基			
金经理。2024年 1月30日至今任 汇添富中证红利 交易型开放式指 数证券投资基金 发起式联接基金 的基金经理。 2024年2月7日 至今任汇添富中 证 1000交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2024年3月12日至今任 汇添富上证科创 板芯片指数型发 起式证券投资基			
1月30日至今任 汇添富中证红利 交易型开放式指 数证券投资基金 发起式联接基金 的基金经理。 2024年2月7日 至今任汇添富中 证1000交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2024年3 月12日至今任 汇添富上证科创 板芯片指数型发 起式证券投资基			
汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。 2024年2月7日至今任汇添富中证 1000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年3月12日至今任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基			
交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024年2月7日至今任汇添富中证1000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年3月12日至今任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基			
数证券投资基金 发起式联接基金 的基金经理。 2024年2月7日 至今任汇添富中 证 1000交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2024年3 月12日至今任 汇添富上证科创 板芯片指数型发 起式证券投资基			
发起式联接基金的基金经理。 2024年2月7日至今任汇添富中证1000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年3月12日至今任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基			
的基金经理。 2024年2月7日 至今任汇添富中 证 1000交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2024年3 月12日至今任 汇添富上证科创 板芯片指数型发 起式证券投资基			
2024年2月7日 至今任汇添富中 证 1000 交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2024年3 月12日至今任 汇添富上证科创 板芯片指数型发 起式证券投资基			., .,
至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年3月12日至今任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基			
证 1000 交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2024 年 3 月 12 日至今任 汇添富上证科创 板芯片指数型发 起式证券投资基			
开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2024年3 月12日至今任 汇添富上证科创 板芯片指数型发 起式证券投资基			
投资基金的基金 经理。2024年3 月12日至今任 汇添富上证科创 板芯片指数型发 起式证券投资基			
经理。2024年3 月12日至今任 汇添富上证科创 板芯片指数型发 起式证券投资基			
月12日至今任 汇添富上证科创 板芯片指数型发 起式证券投资基			
汇添富上证科创 板芯片指数型发 起式证券投资基			•
板芯片指数型发起式证券投资基			
起式证券投资基			
			板芯片指数型发
金的基金经理。			起式证券投资基
			金的基金经理。

					2024年3月26 日至今任汇添富 中证电信主题交 易型开放式指数 证券投资基金发 起式联接基金的 基金经理。2024 年4月19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。 2024年4月19 日至今任汇添富 国证港股通创新
					药交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基 金的基金经理。 2024年6月4日 至今任汇添富中 证芯片产业交易
					型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024年6月20日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易到开放工
					业交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基 金的基金经理。
乐无穹	本基金的基金经理	2019年07 月26日	2024年 04 月 19 日	10	国籍:中国。学经历:学经。从少资本:处资格:证券投资基金从业资格。从业资格。从业经历:2014年7月加入汇资程则为证据的有限公司,现代证据的理价。由于1
					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 2023 年
		8月29日任中证
		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
		2024年4月19
		日任中证长三角
		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 2022 年
		11月21日任汇
		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。2021年7月
		8 日至今任汇添
		富中证沪港深互
		联网交易型开放
		式指数证券投资
		基金的基金经
		理。2021年7月
		27 日至今任汇添
		富中证芯片产业
		交易型开放式指
		数证券投资基金
		的基金经理。
		2021年9月27
		日至今任汇添富
		中证沪港深科技
		龙头交易型开放
		式指数证券投资
		基金的基金经
		理。2021年9月
		29 日至今任汇添

		富中证 800 交易
		型开放式指数证
		券投资基金联接
		基金的基金经
		理。2021年9月
		29 日至今任汇添
		富中证沪港深科
		技龙头指数型发
		起式证券投资基
		金的基金经理。
		2021年10月26
		日至 2022 年 10
		月 30 日任汇添
		富恒生科技指数
		型发起式证券投
		资基金(QDII)
		的基金经理。
		2021年10月29
		日至今任汇添富
		MSCI 中国 A50 互
		联互通交易型开
		放式指数证券投
		资基金的基金经
		理。2021年12
		月 28 日至今任
		汇添富中证沪港
		深云计算产业指
		数型发起式证券
		投资基金的基金
		经理。2022年1
		月 11 日至 2023
		年11月28日任
		汇添富 MSCI 中
		国 A50 互联互通
		交易型开放式指
		数证券投资基金
		联接基金的基金
		经理。2022年3
		月 29 日至 2022
		年 11 月 21 日任
		汇添富中证人工
		智能主题交易型
		开放式指数证券
		投资基金联接基
		金的基金经理。
		2022年6月13

		日至 2023 年 9
		月 28 日任中证
		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。
		2022年7月29
		日至 2024 年 2
		月7日任汇添富
		中证 1000 交易
		型开放式指数证
		券投资基金的基
		金经理。2022年
		8月31日至今任
		汇添富恒生科技
		交易型开放式指
		数证券投资基金
		(QDII) 的基金
		经理。2022年
		10月31日至今
		任汇添富恒生科
		技交易型开放式
		指数证券投资基
		金发起式联接基
		金(QDII)的基
		金经理。2022年
		12月7日至今任
		汇添富恒生香港
		上市生物科技交
		易型开放式指数
		证券投资基金
		(QDII) 的基金
		经理。2023年4
		月 13 日至今任
		汇添富恒生指数
		型证券投资基金
		(QDII-LOF) 的
		基金经理。2023
		年5月24日至
		今任汇添富中证
		国新央企股东回
		报交易型开放式
		指数证券投资基
		金的基金经理。
	i l	2023年6月19

日至小征公司			
型开放式指弧接基金联接基金的基金。经月23 年8 汇添 2023 年8 汇添 2023 年8 汇添 2024 年8 汇添 2024 年 8 汇 2024 年 1 月 23 日 国国证金是 理。2023 年 1 2 月 28 日 国国证交易证券投资基金企理。2024 年 2 月 26 日 国证交易证券投资基金经理。2024 年 2 月 5 日 经产 1 高 MSCI 高 MSCI 海 高 中 证 M 和 对 表 全 经 理 1 日 年 4 月 1 日 至 今 任 汇 海 河 政 基 年 4 月 1 日 至 全 信 加 新 次 基 年 4 月 1 日 年 1 元 本 6 世 证 为 次 基 年 4 月 1 日 年 1 元 本 6 世 证 为 2 公24 年 1 月 9 日 年 4 月 1 9 日 年 4 月 1 9 日 年 5 日 下 3 下 3 下 3 下 3 下 3 下 3 下 3 下 3 下 3 下			日至今任汇添富
券投资基金联接基金的基金经理。2023年8月23日至今任汇添富中证智能汽放工业金经理。2023年12月28日国际影型开放资基金的建金经理。2024年12月28日国际影型开放资本。2024年2月5日至今张股通的对武基金经理,2024年2月5日至今美页级联验金经理,2024年2月5日至今美元开放基金企经理,2024年1日三年十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二			中证 1000 交易
基金2023年8月23日至今任汇率富中避免型开放工作。1000年2011年2月28日11年2月28日11年2日12日2日2年2日12日2日2日2日2日2日2日2日2日2日2日2日			型开放式指数证
理。2023 年 8 月 23 日至今任汇添富中证添富中证添富中证验数型开投资基金经理。2023 年 12 月 28 日至今任汇添富新者指数配基金经理。2023 年 12 月 28 日至一进入股票的,在 20 24 年 2 月 5 日 M SCI 上海富 新者指数 1			券投资基金联接
23 日至今任江添富中证效 型开放 式指 型型开放 式指 图型开放 式指 的基金经 理。2023 年 12 月 28 日 日 国 证 地 型 开放 资基金 经 理。2024 年 2 月 5 日 医 证 港 型 开放 资基金 经 理。2024 年 2 月 5 日 医 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三			基金的基金经
富中证务是整理开放式量的基金经理。2023年12月28日至今任汇添高新药数证金数理。2023年12月28日至今任汇添高新药数型开放式量数证券投资理。2024年2月5届MSCI美国50交易型投资基金经理。2024年2月5届MSCI美国50交易型投资基金全经理。2024年3月1日恒和大资基金全经理。2024年4月1日中间新放资基金全经理。2024年4月1日中间新放资理。2024年4月1日中间新放资理。2024年4月1日中间新放资理。2024年4月1日中间新放资理。2024年4月1日日正港型投资理。2024年4月1日日正港型投资理。2024年4月1日日正港型投资理。2024年4月1日日正港型开政资理。2024年4月1日日正港型开政资基金发起式联接基金发起式联接基金发起式联接基			理。2023年8月
富中证务是整理开放式量的基金经理。2023年12月28日至今任汇添高新药数证金数理。2023年12月28日至今任汇添高新药数型开放式量数证券投资理。2024年2月5届MSCI美国50交易型投资基金经理。2024年2月5届MSCI美国50交易型投资基金全经理。2024年3月1日恒和大资基金全经理。2024年4月1日中间新放资基金全经理。2024年4月1日中间新放资理。2024年4月1日中间新放资理。2024年4月1日中间新放资理。2024年4月1日中间新放资理。2024年4月1日日正港型投资理。2024年4月1日日正港型投资理。2024年4月1日日正港型投资理。2024年4月1日日正港型开政资理。2024年4月1日日正港型开政资基金发起式联接基金发起式联接基金发起式联接基			
主题交易型开放 式金经 理。2023年12 月28日至今任 汇添富国证港股 通创新药药型 开放式指数证券 投资基金。2024年2 月5日至年至 美国 50交易型开放式 指数证券投资基金(QDII)的数基 金全理。2024年 11日至全香港 上市里村改英基金 (QDII)发达基金 (QDII)发达基金 (QDII)发达基。 (QDII)发达基。 (QDII)发达基。 (QDII)发达基。 (QDII)发达基。 (QDII)发达基。 (QDII)发达是。 (Q			
式指数基金经 理。2023年12 月28日至今任 汇添前新考数证券股 通面交易型 开放式指数或证券 投资基金的基金 经理。2024年2 月5日至今任江添高 MSCI 美国 50 交易类投资基金 6(QDII) 0基金 6(QDIII) 0基金 6(QDIIII) 0基金 6(QDIIII) 0基金 6(QDIIII) 0基金 6(QDIIII) 0基金 6(QDIIII) 0基金 6(QDIIII) 0基金 6(QDIIIII) 0基金 6(QDIIIII) 0基金 6(QDIIIIIII) 0基金 6(QDIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIIII			
基金的基金经理。2023年12月28日至今任汇添富国证港股通的新药交易型开放资基金的基金经理。2024年2月5日至今任汇添富MSCI美国元的交易型开资基金(约月1)的基金经理。2024年3月1日至今任汇添富中的大量基金(《即11)的基金经理。2024年4月1日至今已汇添富中证信第产业交易型开资基金的基金经理。2024年4月1日至个任汇添富中证的新产业业交易型产品,在通过产品,通过产品,在通过产品,和,在通过产品,在通过,在通过产品,在通过产品,和通过产品,和通过产品,在通过产品,在通过产品,在通过产品,在通过产品,在通过产品,和通过产品,和,在通过,和,是,是,是一种品,是,是一			
理。2023年12月28日至今任 汇添富国证港股 通创新药交易型 开放式指数联基。2024年2月5日至今任汇 添富 MSCI 美国 50 交易型开放式 指数证券投资基金(QDII)的基 金经理。2024年3月1日至全香港 上市生物科技交 易型开放或指数 证券投资基金(QDII)的基金 经理。2024年4月1日至全信汇 添富中创新产业 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月18日至今任汇			
月 28 日至今任 汇添富国证券股 通创新药交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2024年2 月 5 日至今任汇 添富 MSCI 美国 50 交易型开放式 指数证券投资基金 (QDII)的基 金经理。2024年 3 月 1 日至今任 汇添自和大资基基金 (QDII)数据 基金经理。2024年 4 月 1 日至一间新产业 交易型开放式指 数证券投资基金 的基金经理。 2024年 4 月 19 日至今任汇逾新 药交易型行政式 指数证券收货基金			
汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数基金经理。2024年2月5日至今任汇添富 MSCI 美国 50 交易外型开放式指数 2024年3月1日至今任汇添富 MSCI 美国 50 交易外型,所该基金(QDII)的基金经理。2024年3月1日至今任汇添高生物科技数证券投资基金(QDII)的基金发起式联接基金(QDII)的基金经理。2024年4月1日至一个息技术应用创新式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金发起式联接基金发起式联接基金发起式联接基			
通创新药交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2024年2 月5日至今任汇 添富 MSCI 美国 50 交易型开放式 指数证券投资基金 企经理。2024年 3月1日至今任 汇添富中村技交 易型开放式指数 证券投资基金 (QDII)的基金 经理。2024年4 月1日至今任汇 添富中记自技 术应用创新产业 交易型开放基金 的基金经理。 2024年4 月1日至今任汇 添富国证港股通新 药交易型开放连基金 的基金经理。			
开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年2月5日至今任汇添富 MSCI 美国50 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2024年3月1日至今任汇添富中独大交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金发理。2024年4月1日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放基金的基金发理。2024年4月1日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金发理。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通制新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金发起式联接基			
投资基金的基金经理。2024年2月5日至今任汇添富MSCI美国50交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2024年3月1日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2024年4月1日至今任汇添富中创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月1日至今任汇添富用创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金发起式联接基金发起式联接基			
经理。2024年2月5日至今任汇添富MSCI美国50交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2024年3月1日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金发理。2024年4月1日至今任汇添富中证额之外企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月1日至今任汇添富国证港股通的新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金发起式联接基金发起式联接基			
月5日至今任汇添富 MSCI 美国 50 交易型开放式 指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2024 年3 月1日至今任 汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金 经理。2024 年4 月1日至今任汇添富中证信技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金 的基金经理。2024 年4 月 19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金发起式联接基金发起式联接基			
添富 MSCI 美国 50 交易型开放式 指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2024 年 3 月 1 日至今任 汇添富恒生香港上市生物科技交 易型开放式指数 证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 的基金 经理。2024 年 4 月 1 日至今任汇 添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金 的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任汇添富 国证港股通创新药交易型开放式 指数证券投资基金发起式联接基金发起式联接基			-
50 交易型开放式 指数证券投资基 金(QDII)的基 金经理。2024 年 3 月 1 日至今任 汇添富恒生香港 上市生物科技交 易型开放式指数 证券投资基金 (QDII)的基金 经理。2024 年 4 月 1 日至今任汇 添富中证证新产业 交易型开放式指 数证券投资基金 的基金经理。 2024 年 4 月 19 日至今任汇添富 国证港股通创新 药交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基			
指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2024年3月1日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2024年4月1日至今任汇添富中证信技术应用创新产业交易型开放式指数证券投理。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金发起式联接基			
金(QDII)的基金经理。2024年3月1日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理。2024年4月1日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基			
金经理。2024年3月1日至今任 汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)的基金经理。2024年4月1日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基			
汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理。2024年4月1日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基			
上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理。2024年4月1日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基			3月1日至今任
上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理。2024年4月1日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基			汇添富恒生香港
证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理。2024年4月1日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基			上市生物科技交
起式联接基金 (QDII) 的基金 经理。2024年4月1日至今任汇 添富中证信息技术应用创新产业 交易型开放式指数证券投资基金 的基金经理。2024年4月19日至今任汇添富 国证港股通创新 药交易型开放式 指数证券投资基金发起式联接基			易型开放式指数
(QDII)的基金经理。2024年4月1日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基			证券投资基金发
经理。2024年4月1日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基			起式联接基金
月1日至今任汇 添富中证信息技术应用创新产业 交易型开放式指 数证券投资基金 的基金经理。 2024年4月19 日至今任汇添富 国证港股通创新 药交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基			(QDII) 的基金
添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基			经理。2024年4
术应用创新产业 交易型开放式指 数证券投资基金 的基金经理。 2024年4月19 日至今任汇添富 国证港股通创新 药交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基			月1日至今任汇
交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基			添富中证信息技
数证券投资基金的基金经理。 2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基			术应用创新产业
的基金经理。 2024年4月19 日至今任汇添富 国证港股通创新 药交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基			交易型开放式指
2024年4月19 日至今任汇添富 国证港股通创新 药交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基			数证券投资基金
日至今任汇添富 国证港股通创新 药交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基			的基金经理。
国证港股通创新 药交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基			2024年4月19
			日至今任汇添富
指数证券投资基 金发起式联接基			国证港股通创新
金发起式联接基			药交易型开放式
			指数证券投资基
金的基金经理。			金发起式联接基
			金的基金经理。

注: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。

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。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.1 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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期內遵守《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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,保障公平交易制度的 执行和实现。具体情况如下:

- 一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程,公平交易管控覆盖公司所有业 务类型、投资策略、投资品种,以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理 活动相关的各个环节。
- 二、本着"时间优先、价格优先"的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用 交易系统中的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。
- 三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,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平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上,本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,严格执行了 公平交易制度,公平对待旗下各投资组合。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况。

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,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 5 次,投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控,事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析,未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外,为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突,本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面,对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度 A 股整体承压,万得全 A 下跌 5.32%。分行业来看,中信一级行业中银行、电力公用事业和交通运输等行业表现较好,消费者服务、传媒和商贸零售等行业则表现欠佳。风格上,大市值、价值和红利风格占优,小市值和成长风格相对低迷,A 股整体仍体现出偏防御的特征。

国内 5 月和 6 月经济数据显示,经济修复仍存一定波折。5 月工业增加值同比增长 5.6%,固定资产投资同比增长 3.5%,双双环比走弱且低于预期,社零同比增长 3.7%,环比修复较明显。6 月 PMI 录得 49.5,继续位于荣枯线之下,显示制造业边际走弱,综合 5 月和 6 月数据来看,国内经济修复基础仍不牢固。后续政策端或将继续发力,经济有望平稳修复。

海外方面,6月美联储议息会议维持基准利率不变,"点阵图"将年内降息次数从3次下调至1次,整体降息次数从6次降至5次,呈现出比市场预期更为"鹰派"的特征。

今年 4 月,继 2004 年、2014 年两个"国九条"后,时隔十年我国发布第三个资本市场"国九条",新"国九条"以强监管、防风险、促高质量发展为主线,从发行上市、持续监管、退市监管、证券基金机构监管、交易监管、推动中长期资金入市等维度做出总体安排,并会同证监会与三大交易所共同形成"1+N"政策体系。新"国九条"的推出有望优化市场环境,推动资本市场的健康发展,为上市公司和投资者创造更稳健的市场条件。

"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 及其联接基金是投资于长三角区域龙头上市企业的指数产品,覆盖行业主要包括金融、医药、电子等,帮助投资者把握长三角区域发展带来的主题投资机遇。

4.5 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-3.21%。同期业绩比较基准收益率为-4.66%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	333, 472, 524. 78	96. 60
	其中: 股票	333, 472, 524. 78	96. 60
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	10, 732, 397. 28	3. 11
8	其他资产	1, 008, 138. 18	0. 29
9	合计	345, 213, 060. 24	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	_	-
В	采矿业	837, 000. 00	0.24
С	制造业	191, 045, 019. 32	55. 39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6, 545, 738. 00	1.90
Е	建筑业	4, 711, 564. 00	1. 37

F	批发和零售业	6, 808, 512. 87	1. 97
G	交通运输、仓储和邮政业	6, 043, 031. 75	1.75
Н	住宿和餐饮业	546, 924. 00	0.16
Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	26, 033, 514. 44	7. 55
J	金融业	73, 851, 760. 82	21.41
K	房地产业	1, 141, 152. 00	0. 33
L	租赁和商务服务业	1, 483, 472. 20	0. 43
M	科学研究和技术服务业	8, 772, 783. 18	2. 54
N	水利、环境和公共设施管理业	4, 039, 688. 20	1. 17
0	居民服务、修理和其他服务业	_	-
Р	教育	_	-
Q	卫生和社会工作	647, 148. 00	0. 19
R	文化、体育和娱乐业	965, 216. 00	0. 28
S	综合	_	-
	合计	333, 472, 524. 78	96. 68

5.2.2 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持有积极投资的境内股票。

5.2.3 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。

5.3 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

5.3.1报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600919	江苏银	1, 798, 947	13, 366, 176. 21	3.88

		行			
2	601328	交通银	1 440 700	10.700.000.00	3. 12
2		行	1, 440, 700	10, 762, 029. 00	5. 12
3	600276	恒瑞医	274, 686	10 504 400 50	3. 06
J	000270	药	274,000	10, 564, 423. 56	3.00
4	002463	沪电股	271, 938	9, 925, 737. 00	2. 88
4	002463	份	271, 936	9, 925, 131.00	2.00
5	002415	海康威	295, 371	9, 129, 917. 61	2. 65
J		视	255, 571	3, 123, 317. 01	
6	300274	阳光电	145, 239	9, 009, 175. 17	2. 61
0		源			2.01
7	600406	国电南	329, 765	8, 230, 934. 40	2. 39
<u>'</u>		瑞			2.03
8	002142	宁波银	360, 014	7, 941, 908. 84	2. 30
0		行			2.00
9	603259	药明康	196, 962	7, 718, 940. 78	2.24
		德	100, 002	1,110,010.10	2.21
10	300059	东方财	713, 510	7, 534, 665. 60	2. 18
10		富			2.10

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 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。

- **5.5 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债券投资明细** 注:本基金本报告期末未持有债券。
- 5.6 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。

5.7 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。

- 5.8 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权证投资明细 注:本基金本报告期末未持有权证投资。
- 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 5.9.1 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 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2407 IF2407 8.00		8.00	8, 248, 800. 00 -123, 540. 00		
	-123, 540. 00				
	746. 38				
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-130, 860. 00

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5. 11. 1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,江苏银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、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。

5. 11. 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1, 008, 138. 18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	_
4	应收利息	-
5	应收申购款	_
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	1, 008, 138. 18

5.11.4报告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。

- 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
- 5.11.5.1报告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不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§6开放式基金份额变动

单位: 份

本报告期期初基金份额总额	478, 941, 627. 00
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	68, 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	410, 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。

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

注: 本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注: 本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

		报告期	内持有基金份额变化	情况		报告期末持有基金	金情况
		持有基					
		金份额					
投资		比例达					
者类		到或者	期初份额	申购	赎回	持有份额	份额占
别	序号	超过		份额	份额		比(%)
		20%的					
		时间区					
		间					
		2024					
	1	年4月	352, 354, 426. 00				
机构		1日至		_	_	252 254 426 00	85. 74
17114		2024		_		352, 354, 426. 00	00.74
		年6月					
		30 日					

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9备查文件目录

9.1 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规定报刊上 披露的各项公告;
 - 6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

9.3 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 2024年07月19日