

中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2018 第四季度 报告

2018年12月31日

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
报告送出日期:2019年1月21日

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1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。
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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金增值,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。
本报告自2019年10月11日起至2019年12月31日止。

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月14日
报告期末基金份额总额	65,427,364.31份
投资范围	本基金投资于国内A股、港股和境外市场,追求跟踪标的指数并实现超额收益的目标。
投资策略	本基金主要投资于目标ETF,力争通过多种手段通过本基金投资目标ETF,本基金不参与目标ETF的资产管理。
业绩比较基准	中证上海国企指数收益率*90%+恒生沪深港通互联互通指数收益率*10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,中证上海国企指数收益率*90%+恒生沪深港通互联互通指数收益率*10%为本基金的风险收益特征。本基金为主动型股票基金,跟踪中证上海国企指数,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	中国工商银行股份有限公司

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	501009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-07-20
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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,284,615.79	6.48
2	固定收益	3,284,615.79	6.48
3	货币投资	643,891,764.91	94.08
4	衍生品投资	-	-
5	买入返售	-	-
6	其他资产	-	-
7	负债	-	-
8	净资产	-	-
9	总资产	50,505,714.80	5.40
10	净资产	29,573,737.37	5.80
11	负债	643,891,764.91	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
A	股票	3,097.20	0.00
B	债券	-	-
C	货币	61,911.06	0.12
D	其他	40,404.64	0.08
E	买入返售	135,482.08	0.27
F	其他资产	197,213.00	0.39
G	负债	56,737.97	0.11
H	净资产	66,600.00	0.13
I	信用债	64,676.00	0.13
J	其他	780,203.00	1.54
K	其他	580,266.00	1.15
L	其他	7,540.00	0.01
M	其他	7,880.00	0.01
N	其他	13,720.00	0.03
O	其他	30,360.00	0.06
P	其他	-	-
Q	其他	24,760.00	0.05
R	其他	32,175.00	0.06
S	其他	3,284,615.79	6.48

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	11,000	0.02
2	固定收益	5,000	0.01
3	货币投资	20,000	0.04
4	衍生品投资	-	-
5	买入返售	85,000	0.16
6	其他资产	12,000	0.02
7	负债	19,000	0.04
8	净资产	28,000	0.05
9	总资产	120,000	0.22
10	净资产	5,000	0.01
11	负债	85,000	0.16

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	11,000	0.02
2	固定收益	5,000	0.01
3	货币投资	20,000	0.04
4	衍生品投资	-	-
5	买入返售	85,000	0.16
6	其他资产	12,000	0.02
7	负债	19,000	0.04
8	净资产	28,000	0.05
9	总资产	120,000	0.22
10	净资产	5,000	0.01
11	负债	85,000	0.16

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	11,000	0.02
2	固定收益	5,000	0.01
3	货币投资	20,000	0.04
4	衍生品投资	-	-
5	买入返售	85,000	0.16
6	其他资产	12,000	0.02
7	负债	19,000	0.04
8	净资产	28,000	0.05
9	总资产	120,000	0.22
10	净资产	5,000	0.01
11	负债	85,000	0.16

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	11,000	0.02
2	固定收益	5,000	0.01
3	货币投资	20,000	0.04
4	衍生品投资	-	-
5	买入返售	85,000	0.16
6	其他资产	12,000	0.02
7	负债	19,000	0.04
8	净资产	28,000	0.05
9	总资产	120,000	0.22
10	净资产	5,000	0.01
11	负债	85,000	0.16

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	11,000	0.02
2	固定收益	5,000	0.01
3	货币投资	20,000	0.04
4	衍生品投资	-	-
5	买入返售	85,000	0.16
6	其他资产	12,000	0.02
7	负债	19,000	0.04
8	净资产	28,000	0.05
9	总资产	120,000	0.22
10	净资产	5,000	0.01
11	负债	85,000	0.16

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	11,000	0.02
2	固定收益	5,000	0.01
3	货币投资	20,000	0.04
4	衍生品投资	-	-
5	买入返售	85,000	0.16
6	其他资产	12,000	0.02
7	负债	19,000	0.04
8	净资产	28,000	0.05
9	总资产	120,000	0.22
10	净资产	5,000	0.01
11	负债	85,000	0.16

7	000006	绿地控股	29,800	182,078.00	0.61
8	001727	上海电气	28,200	191,308.00	0.61
9	000663	陆家嘴	9,300	120,807.00	0.61
10	001211	国泰君安	5,600	88,792.00	0.61

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合