

汇添富上证综合指数证券投资基金

2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 28 日

§ 1 重要提示

基金管理人的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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 26 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。

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 2020 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇添富上证综合指数
基金主代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 7 月 1 日
报告期末基金份额总额	852,435,470.29 份
投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 6%，以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。
业绩比较基准	上证综合指数收益率×95% + 银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。
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

§ 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（2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	74,993,217.24
2. 本期利润	120,866,020.85
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1371
4. 期末基金资产净值	988,147,569.57
5. 期末基金份额净值	1.159

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 本报告期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	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
过去三个月	12.39%	1.37%	7.46%	1.44%	4.93%	-0.07%
过去六个月	21.63%	1.11%	16.16%	1.16%	5.47%	-0.05%
过去一年	16.79%	1.17%	10.34%	1.21%	6.45%	-0.04%
过去三年	9.80%	1.11%	-3.41%	1.15%	13.21%	-0.04%
过去五年	27.90%	1.13%	5.70%	1.15%	22.20%	-0.02%
自基金合同 生效日起至 今	33.93%	1.33%	9.92%	1.32%	24.01%	0.01%

3.2.2 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

汇添富上证综合指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为自《基金合同》生效之日（2009 年 7 月 1 日）起 3 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监	2010 年 2 月 5 日	—	14 年	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：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股份有限公司，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 安中指

					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。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、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；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《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

本基金管理人高度重视投资者利益保护。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、营运、风险管理以及合规稽核等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事

中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

对于同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3 日内和 5 日内）同买或者同卖同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。根据 95%置信区间下平均价差率的 T 检验显著程度、同向交易占优比等方面进行综合分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。本报告期内，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，本公司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，公平对待了旗下各投资组合。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，本公司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 1 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾三季度，7 月初市场在金融板块的带动下出现短暂快速上涨行情，但未能持续，整个三季度行情震荡缺乏主线。国内经济从疫情中逐步恢复，各类经济指标出现显著改善，景气行业从医药、科技逐步扩展到周期、制造。货币政策从应急式宽松步入常态化，强调精准调节，支持实体经济恢复与可持续发展。金融改革提速，健全鼓励中长期资金开展价值投资的制度体系，创业板注册制推出，推升交易活跃度和流动性。投资者结构方面，北上资金从趋势性流入转为波动，公募主动权益基金发行热度持续，A 股机构化程度提升趋势未变。

与海外动荡的环境相对比，国内经济恢复及政策层面的确定性更强、预期更为乐观。三季度以来人民币持续升值，提升了人民币计价的资产价值，对海外增量资金的吸引力进一步增强，有望成为国内资本市场的有力支撑。行业层面，市场热点从具有“内循环”性质、享受确定性溢价的医药、消费板块逐步扩散到受益于经济复苏、行业景气度提升的新能源及部分周期制造板块，一些与经济复苏相关的顺周期行业也将因为其低估值而迎来配置型投资机会，市场的投资机会将更加均衡一些。上证指数这样行业和风格分布均衡的宽基指数也是比较顺应当前投资逻辑的品种。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。权益投资仓

位报告期内基本保持在 90%~95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.159 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.39%，业绩比较基准收益率为 7.46%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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	931,805,453.26	94.08
	其中：股票	931,805,453.26	94.08
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,084,913.00	0.21
	其中：债券	2,084,913.00	0.21
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	0.00	0.00
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	55,300,107.17	5.58
8	其他资产	1,281,095.22	0.13
9	合计	990,471,568.65	100.00

注：本基金本报告期末参与转融通参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 88,639,846.00 元，占基金资产净值比例 8.97%。

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	2,169,812.76	0.22
B	采矿业	54,983,815.68	5.56
C	制造业	391,029,359.11	39.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,169,666.40	3.26

E	建筑业	22,134,015.57	2.24
F	批发和零售业	20,607,689.05	2.09
G	交通运输、仓储和邮政业	38,123,264.93	3.86
H	住宿和餐饮业	1,064,421.21	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,649,663.07	3.00
J	金融业	270,651,773.61	27.39
K	房地产业	25,307,482.70	2.56
L	租赁和商务服务业	12,562,523.10	1.27
M	科学研究和技术服务业	9,488,893.75	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	5,263,328.00	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	5,324,828.00	0.54
R	文化、体育和娱乐业	5,897,297.83	0.60
S	综合	1,291,485.88	0.13
	合计	927,719,320.65	93.88

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

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	3,113,554.94	0.32
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	16,793.79	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	30,812.50	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	924,971.38	0.09
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	—	—
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	4,086,132.61	0.41

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 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

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	600519	贵州茅台	33,862	56,498,747.00	5.72
2	601288	农业银行	11,678,573	37,021,076.41	3.75
3	601988	中国银行	9,028,511	28,891,235.20	2.92
4	601628	中国人寿	505,371	22,453,633.53	2.27
5	601318	中国平安	290,903	22,184,262.78	2.25
6	600036	招商银行	542,015	19,512,540.00	1.97
7	601857	中国石油	4,261,957	17,516,643.27	1.77
8	600276	恒瑞医药	157,243	14,123,566.26	1.43
9	603288	海天味业	86,150	13,964,915.00	1.41
10	601888	中国中免	48,605	10,835,998.70	1.10

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

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	688567	孚能科技	49,442	1,111,456.16	0.11
2	688536	思瑞浦	3,566	780,989.66	0.08
3	688408	中信博	4,450	411,091.00	0.04
4	688336	三生国健	14,352	376,740.00	0.04
5	688311	盟升电子	4,182	322,264.92	0.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,084,913.00	0.21
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,084,913.00	0.21

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019627	20 国债 01	20,870	2,084,913.00	0.21

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。

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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	55,091.79
2	应收证券清算款	144,697.63
3	应收股利	6,219.05
4	应收利息	64,851.91
5	应收申购款	1,010,234.84
6	其他应收款	-

7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,281,095.22

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的情况。

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688567	孚能科技	1,111,456.16	0.11	新股流通受限
2	688536	思瑞浦	780,989.66	0.08	新股流通受限
3	688408	中信博	411,091.00	0.04	新股流通受限
4	688336	三生国健	376,740.00	0.04	新股流通受限
5	688311	盟升电子	322,264.92	0.03	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	919,416,721.41
报告期期间基金总申购份额	266,186,433.99
减：报告期期间基金总赎回份额	333,167,685.11
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	852,435,470.29

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：本报告期内基金管理人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：本报告期内基金管理人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超过 20%的情况

注：无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富上证综合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、报告期内汇添富上证综合指数证券投资基金在指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

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 层 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

2020 年 10 月 28 日