

汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资 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：招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。

基金托管人招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	添富沪深 300ETF
场内简称	添富 300
基金主代码	515310
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 4 日
报告期末基金份额总额	164,111,220.00 份
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。
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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
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，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。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	招商银行股份有限公司

注：本基金扩位证券简称为沪深 300 添富 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（2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	3,826,514.11
2. 本期利润	-3,992,262.21
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0434
4. 期末基金资产净值	192,063,799.65
5. 期末基金份额净值	1.1703

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。

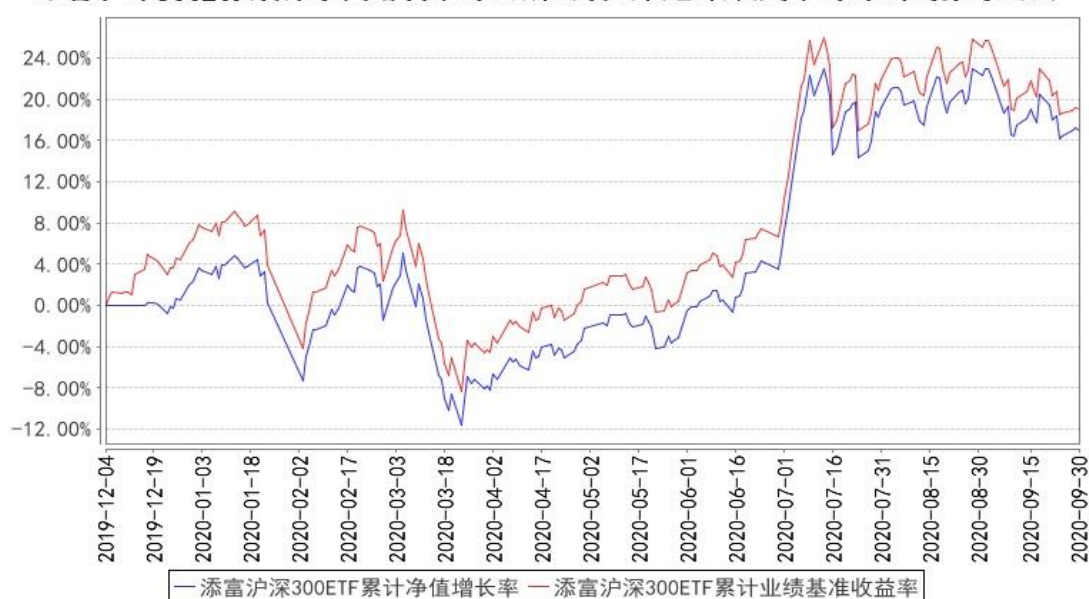
3.2 基金净值表现

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	11.40%	1.61%	10.17%	1.62%	1.23%	-0.01%
过去六个月	27.04%	1.31%	24.45%	1.32%	2.59%	-0.01%
自基金合同 生效日起至 今	17.03%	1.45%	19.12%	1.49%	-2.09%	-0.04%

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

添富沪深300ETF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：本基金的《基金合同》生效日为 2019 年 12 月 4 日，截止本报告期末，基金成立未满 1 年。
 本基金建仓期为自《基金合同》生效之日（2019 年 12 月 4 日）起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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		
董瑾	本基金的基金经理	2019 年 12 月 5 日	—	11 年	国籍：中国。学历：北京大学西方经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 8 月至 2012 年 12 月任国泰基金管理有限公司产品经理助理，2012 年 12 月至 2015 年 9 月任汇添富基金管理股份有限公司产品经理，2015 年 9 月至 2016 年 10 月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司，2017 年 12 月 18 日至 2019 年 8 月 27 日任上证上海改革发展主题 ETF 的基金经理助理，2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任上海国企 ETF 联接、汇添富沪深 300 指数（LOF）、汇添富中证全指证券公司指数（LOF）的基金经理助理，2019 年 12 月 4 日至今任添富沪深 300ETF 的基金经理，2019 年 12 月 31 日至今任上海国企 ETF 联接、汇添富沪深 300 指数

					(LOF)、汇添富中证全指证券公司指数(LOF)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遵规守信情况的说明

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控管控,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

三季度，经济平稳中延续改善趋势，经济运行结构更趋于合理。9 月制造业 PMI 上涨，供需分化继续收敛，新出口订单连续第 5 个月反弹，小企业景气度重回扩张区间，反映经济复苏提速，服务业修复持续加速。各方面数据显示经济活动正处于恢复中，预计经济运行热度将逐渐上升，后续增长态势更趋明晰。但中期仍需关注美国总统大选、中美贸易摩擦、海外疫情反复等事件或将带来的不确定性影响。

政策方面，财政政策要更加积极有为、注重实效。要保障重大项目建设资金，注重质量和效益。央行货币政策委员会第三季度例会指出，稳健的货币政策要更加灵活适度、精准导向，综合运用并创新多种货币政策工具，保持流动性合理充裕。有效发挥结构性货币政策工具的精准滴灌作用，提高政策的“直达性”。

市场和资金面上，由于宏观流动性边际收紧、海外疫情反复等原因，A 股市场维持震荡调整态势。8 月以来，市场成交额和换手率有所回落，交投情绪有所降温。北上资金方面，短期交易型外资进出频繁，配置型外资流入仍是长期趋势。

从上市公司业绩预告情况来看，预计各个大类行业第三季度利润都将出现不同程度好转。结构上来看，下游消费行业保持较强的复苏态势，如餐饮、医药和汽车等。中游制造中的机械等行业工业企业利润增速也已经转正。钢铁、煤炭等上游行业业绩恢复仍相对较慢。从市场表现来看，那些行业持续修复和业绩不断改善的行业或将成为市场配置的主线。

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，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

本基金本报告期基金份额净值增长率为 11.40%。同期业绩比较基准收益率为 10.17%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。8 月 14 日之后，基金

资产净值不再低于五千万元。

§ 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	175,580,599.94	90.57
	其中：股票	175,580,599.94	90.57
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	14,614,717.91	7.54
8	其他资产	3,676,385.70	1.90
9	合计	193,871,703.55	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	2,239,041.60	1.17
B	采矿业	4,263,049.00	2.22
C	制造业	85,817,824.58	44.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,474,959.00	1.81
E	建筑业	3,363,937.00	1.75
F	批发和零售业	1,632,623.00	0.85
G	交通运输、仓储和邮政业	4,874,318.60	2.54
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,766,570.10	3.00
J	金融业	49,649,328.90	25.85
K	房地产业	6,409,650.10	3.34
L	租赁和商务服务业	3,014,242.00	1.57
M	科学研究和技术服务业	1,171,310.00	0.61
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	238,199.00	0.12

Q	卫生和社会工作	2,122,819.60	1.11
R	文化、体育和娱乐业	1,143,581.60	0.60
S	综合	—	—
	合计	175,181,454.08	91.21

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	352,946.27	0.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	13,029.12	0.01
F	批发和零售业	16,793.79	0.01
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	16,376.68	0.01
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	399,145.86	0.21

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	5,600	9,343,600.00	4.86
2	601318	中国平安	119,900	9,143,574.00	4.76
3	000858	五粮液	21,200	4,685,200.00	2.44
4	600036	招商银行	116,200	4,183,200.00	2.18
5	000333	美的集团	53,905	3,913,503.00	2.04

6	600276	恒瑞医药	39,360	3,535,315.20	1.84
7	600030	中信证券	95,800	2,876,874.00	1.50
8	000651	格力电器	53,600	2,856,880.00	1.49
9	002475	立讯精密	46,660	2,665,685.80	1.39
10	600887	伊利股份	64,500	2,483,250.00	1.29

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	300999	金 龙 鱼	6,359	163,426.30	0.09
2	688330	宏 力 达	774	68,290.02	0.04
3	605336	帅丰电器	701	17,027.29	0.01
4	605136	丽人丽妆	867	16,793.79	0.01
5	003010	若羽臣	562	16,376.68	0.01

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。

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
IF2012	IF2012	7	9,460,080.00	-134,820.00	-
IF2103	IF2103	4	5,359,920.00	-267,060.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-401,880.00

股指期货投资本期收益（元）	213,671.53
股指期货投资本期公允价值变动（元）	-489,120.00

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，结合股指期货定价模型，主要选择估值合理、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：本基金本报告期内未投资国债期货。

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	1,971,015.40
2	应收证券清算款	1,702,805.76
3	应收股利	—
4	应收利息	2,564.54
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,676,385.70

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	300999	金 龙 鱼	163,426.30	0.09	新股流通受限
2	688330	宏 力 达	68,290.02	0.04	新股流通受限
3	605336	帅丰电器	17,027.29	0.01	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	27,611,220.00
报告期期间基金总申购份额	154,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	17,500,000.00
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	164,111,220.00

注：其中“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

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	2020 年 8 月 17 日至 2020 年 9 月 30 日	0.00	84,000,000.00	42,000,000.00	42,000,000.00	25.59
个人	-	-	-	-	-	-	-
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。

§ 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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 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、报告期内汇添富沪深 300 交易型开放式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 楼 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