

汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式 证券投资基金（LOF） 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	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）
基金主代码	501057
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2018 年 5 月 23 日
报告期末基金份额总额	1,500,554,283.33 份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，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	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。 本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	中证新能源汽车产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
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，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	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C
下属分级基金的场内简称	新能源车	新能车 C
下属分级基金的交易代码	501057	501058
报告期末下属分级基金的份额总额	869,938,645.36 份	630,615,637.97 份

注：汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A 的扩位证券简称为新能源车 LOF；汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C 的扩位证券简称为新能源车 LOFC。

§ 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）	
	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C
1. 本期已实现收益	89,870,145.76	60,871,451.88
2. 本期利润	183,057,017.33	125,922,115.05
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1987	0.1953
4. 期末基金资产净值	1,254,321,034.68	902,878,565.66
5. 期末基金份额净值	1.4418	1.4317

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

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A

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④	①—③	②—④
过去三个月	17.11%	2.07%	13.98%	2.12%	3.13%	-0.05%
过去六个月	48.87%	1.85%	44.43%	1.88%	4.44%	-0.03%

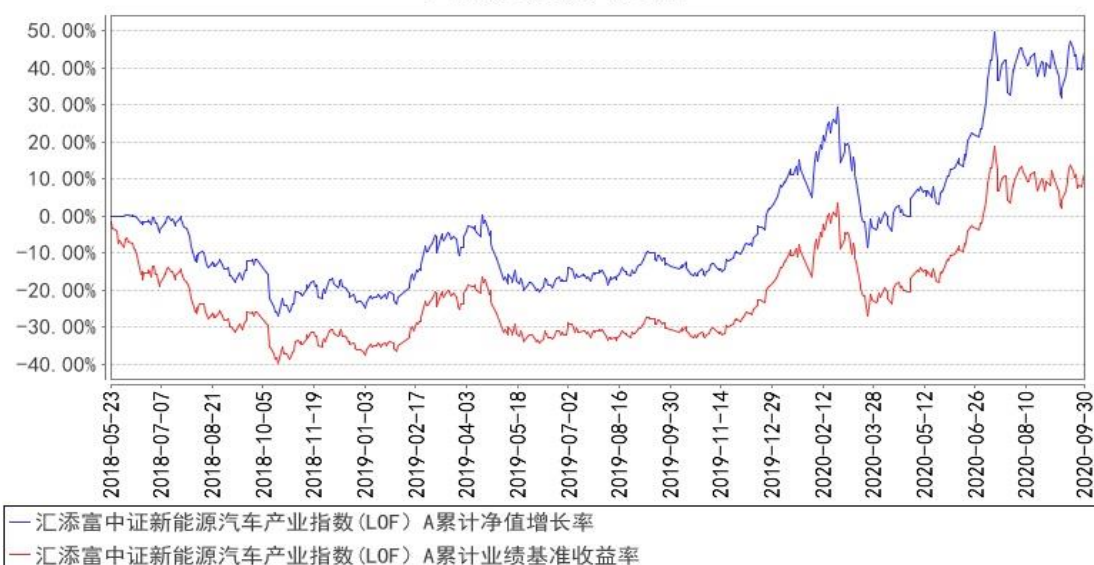
过去一年	66.72%	2.00%	60.76%	2.05%	5.96%	-0.05%
自基金合同 生效日起至 今	44.18%	1.72%	11.37%	1.82%	32.81%	-0.10%

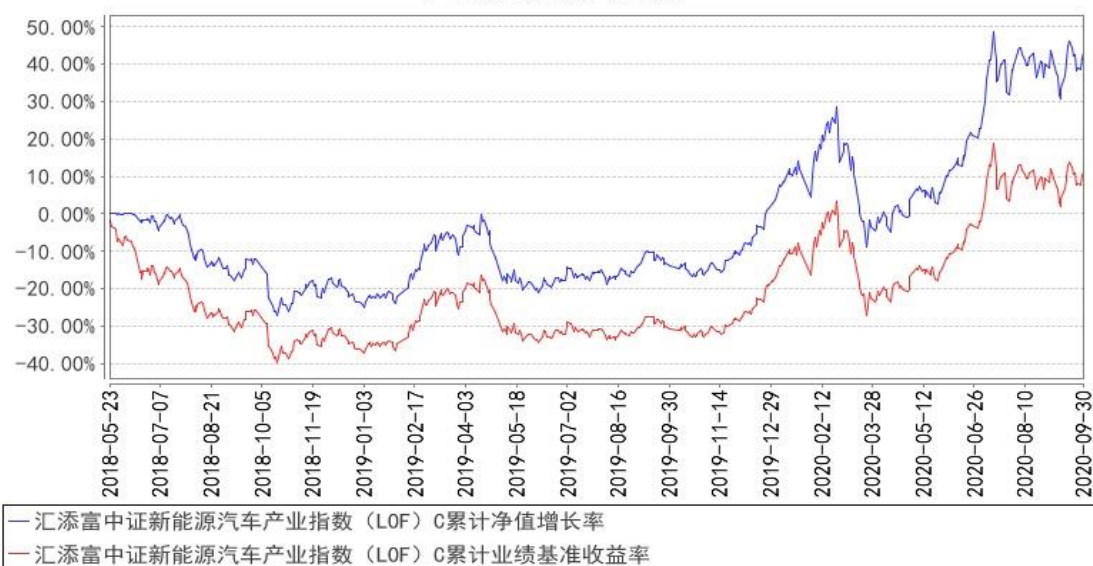
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C

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 ④	①—③	②—④
过去三个月	17.05%	2.07%	13.98%	2.12%	3.07%	-0.05%
过去六个月	48.69%	1.85%	44.43%	1.88%	4.26%	-0.03%
过去一年	66.32%	2.00%	60.76%	2.05%	5.56%	-0.05%
自基金合同 生效日起至 今	43.17%	1.72%	11.37%	1.82%	31.80%	-0.10%

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

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A 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



汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C 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：本基金建仓期为自本《基金合同》生效之日（2018 年 5 月 23 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。

§ 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		
过蓓蓓	本基金的基金经理	2018 年 5 月 23 日	—	9 年	国籍：中国，学历：中国科学技术大学金融工程博士研究生，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理，2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费 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、汇添富中证主要消费 ETF 联接基金的基金经理，2015 年 8 月 18 日至今任汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理，2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技指数（LOF）基金的基金经理，2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证中药指数（LOF）基金的基金经理，2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）基金的基金经理，2018 年 10

					月 23 日至今任中证银行 ETF 基金的基金经理，2019 年 3 月 26 日至今任添富中证医药 ETF 联接基金的基金经理，2019 年 4 月 15 日至今任添富中证银行 ETF 联接基金的基金经理，2019 年 10 月 8 日至今任添富中证 800ETF 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

2020 年三季度 A 股市场以震荡为主。7 月伊始，在金融板块带动下大盘出现了半个月的快速上涨行情，但未能持久。以医药、半导体为代表的高估值板块在 7 月冲高后回调，到季度末基本回到二季度末的位置。休闲服务、国防军工、电气设备在 28 个行业中涨幅居前。三季度北上资金有部分流出，但流出主要来自交易型资金，配置型资金仍保持了相对稳健的流入。

全球疫情仍有反复，欧美及部分发展中国家病例数据表现出二次爆发的迹象。但市场对疫情数据反应钝化，对美国大选的关注度提升。货币政策角度，美联储、欧央行等受疫情影响，将多项缓释型政策执行期限延期至年底，但并没有继续大幅宽松的态势，全球资金面有收缩隐忧。

国内经济稳步修复，全球比较来看表现优秀。经济增长三驾马车出口、消费、投资累计增速均持续回升，其中以投资的回升最为显著。8 月累计城镇固定资产投资增速已接近与去年同期持平，三季度末预计大概率回正。社会消费品零售总额年初以来同比累计降幅不断收窄，8 月单月同比数据已实现年内首次正增长。贸易数据前三季度整体超预期，国际市场份额创下历史新高。工业企业盈利增速、PMI 等数据持续回升，且 PMI 的各分项指标均有不同程度回升，其中产成品库存的回升体现企业开始主动补库存，表明对经济活动的信心显著修复。

正是由于国内经济复苏态势良好，国内货币政策非常节制，不做大水漫灌，强调了结构性调整和精准滴灌，利率水平回到去年末水平，人民币兑美元在三季度大幅升值。七月底召开的政治局会议将十四五计划、2035 年远景目标提上日程。政策定调“国内大循环为主体、国内国际双循环”的发展格局，以应对持久战。此次政治局会议也体现了我国宏观政策一贯的长期性和持久性，不因短期冲击压力而进行过度调节。在外部环境动荡、国际冲突频繁的当下，凸显了内需的重要性，凸显了重要战略领域实现自主发展、在关键领域加强进口替代的重要性。

新能源汽车指数在一季度经历了较大的波动，二、三季度均获得超过大盘的涨幅，中证新能源汽车产业指数三季度上涨 14.67%。新能源汽车产业景气度较高，趋势持续向上，从终端情况来看，欧洲、中国均获得环比、同比大幅增长。欧洲碳排放政策强刺激，传统车企加速转型，新款

新能源车型在 3 季度开始陆续投放市场，供给增加也激发了消费需求。国内造成新势力的新能源车销售情况也较好，体现出国内由补贴和供给双轮驱动、多价格层次全面覆盖的新能源车发展环境。国内产业链在全球的竞争优势进一步体现。

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。股票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

截至本报告期末汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A 基金份额净值为 1.4418 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.11%；截至本报告期末汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C 基金份额净值为 1.4317 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.05%；同期业绩比较基准收益率为 13.98%。

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	2,044,615,446.06	94.20
	其中：股票	2,044,615,446.06	94.20
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	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	119,116,418.55	5.49
8	其他资产	6,679,295.67	0.31
9	合计	2,170,411,160.28	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 116,683,282.00 元，占期末基金资产净值比例 5.41%。

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	—	—
B	采矿业	59,386,080.00	2.75
C	制造业	1,967,480,093.83	91.21
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	12,435,120.00	0.58
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	—	—
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	2,039,301,293.83	94.53

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	5,155,522.85	0.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	28,264.03	0.00
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	45,215.49	0.00
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	14,813.40	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	57,307.34	0.00

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	5,314,152.23	0.25

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投资组合。

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	002594	比亚迪	2,036,824	236,760,421.76	10.98
2	300750	宁德时代	736,467	154,068,896.40	7.14
3	300124	汇川技术	2,337,602	135,347,155.80	6.27
4	300014	亿纬锂能	2,072,198	102,573,801.00	4.75
5	002460	赣锋锂业	1,723,250	93,382,917.50	4.33
6	002812	恩捷股份	985,806	90,171,674.82	4.18
7	002050	三花智控	4,047,356	89,851,303.20	4.17
8	300207	欣旺达	2,478,876	67,152,750.84	3.11
9	603993	洛阳钼业	15,964,000	59,386,080.00	2.75
10	300450	先导智能	1,195,399	57,845,357.61	2.68

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	71,770	1,844,489.00	0.09
2	300888	稳健医疗	10,265	1,026,294.70	0.05
3	688289	圣湘生物	6,806	754,036.74	0.03
4	688526	科前生物	14,620	469,302.00	0.02
5	688330	宏 力 达	3,573	315,245.79	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投资。

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投资。

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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

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	346,446.01
2	应收证券清算款	169,920.85
3	应收股利	—
4	应收利息	75,129.58
5	应收申购款	6,087,799.23
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,679,295.67

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未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	1,844,489.00	0.09	新股流通受限
2	300888	稳健医疗	1,026,294.70	0.05	新股流通受限
3	688330	宏 力 达	315,245.79	0.01	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C
报告期期初基金份额总额	886,525,757.11	599,404,296.44
报告期期间基金总申购份额	706,052,997.24	711,430,454.71
减：报告期期间基金总赎回份额	722,640,108.99	680,219,113.18
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	869,938,645.36	630,615,637.97

注：表内“总申购份额”含红利再投份额。

§ 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

单位：份

项目	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,003,600.36	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,003,600.36	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.15	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总 份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总 份额比例(%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,003,600.36	0.67	10,003,600.36	0.67	3 年
基金管理人高级管理人员	266,571.89	0.02	—	—	—
基金经理等人员	51,950.58	0.00	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	255,053.21	0.02	—	—	—
合计	10,577,176.04	0.71	10,003,600.36	0.67	—

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）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。

10.2 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

10.3 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