

# 汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 2019 年第 4 季度报告

2019 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：中国国际金融股份有限公司

报告送出日期：2020 年 1 月 21 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。

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 01 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。

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 2019 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                    |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 汇添富沪深 300 指数（LOF）                                                                                                                                                                  |
| 基金主代码      | 501043                                                                                                                                                                             |
| 基金运作方式     | 上市契约型开放式（LOF）                                                                                                                                                                      |
| 基金合同生效日    | 2017 年 9 月 6 日                                                                                                                                                                     |
| 报告期末基金份额总额 | 205,329,274.00 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       | <p>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。</p> <p>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</p> |

|                 |                                                                                              |                    |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|
|                 | 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。                                                            |                    |
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率（税后） $\times$ 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，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，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           | 中国国际金融股份有限公司                                                                                 |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 汇添富沪深 300 指数（LOF）A                                                                           | 汇添富沪深 300 指数（LOF）C |
| 下属分级基金的场内简称     | 沪深 300A                                                                                      | 沪深 300C            |
| 下属分级基金的交易代码     | 501043                                                                                       | 501045             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 128,111,246.42 份                                                                             | 77,218,027.58 份    |

### § 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（2019 年 10 月 1 日-2019 年 12 月 31 日） |                    |
|-----------------|---------------------------------------|--------------------|
|                 | 汇添富沪深 300 指数（LOF）A                    | 汇添富沪深 300 指数（LOF）C |
| 1. 本期已实现收益      | 4,932,253.76                          | 3,015,027.10       |
| 2. 本期利润         | 11,463,118.14                         | 7,786,677.36       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0816                                | 0.0907             |
| 4. 期末基金资产净值     | 144,344,792.55                        | 86,791,933.12      |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1267                                | 1.1240             |

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

汇添富沪深 300 指数 (LOF) A

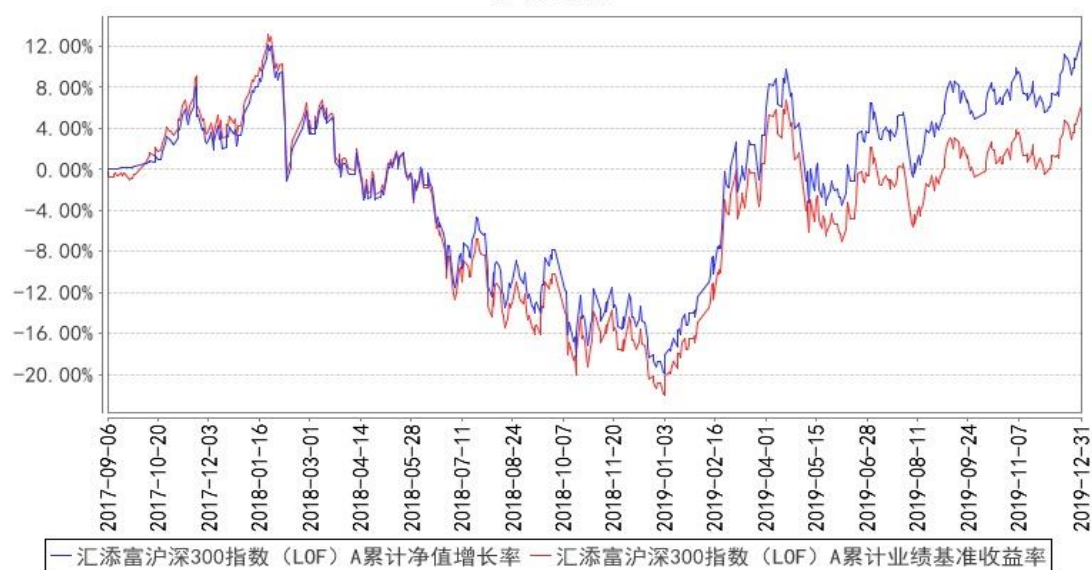
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④    |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 7.42%  | 0.69%     | 7.03%      | 0.70%         | 0.39% | -0.01% |

汇添富沪深 300 指数 (LOF) C

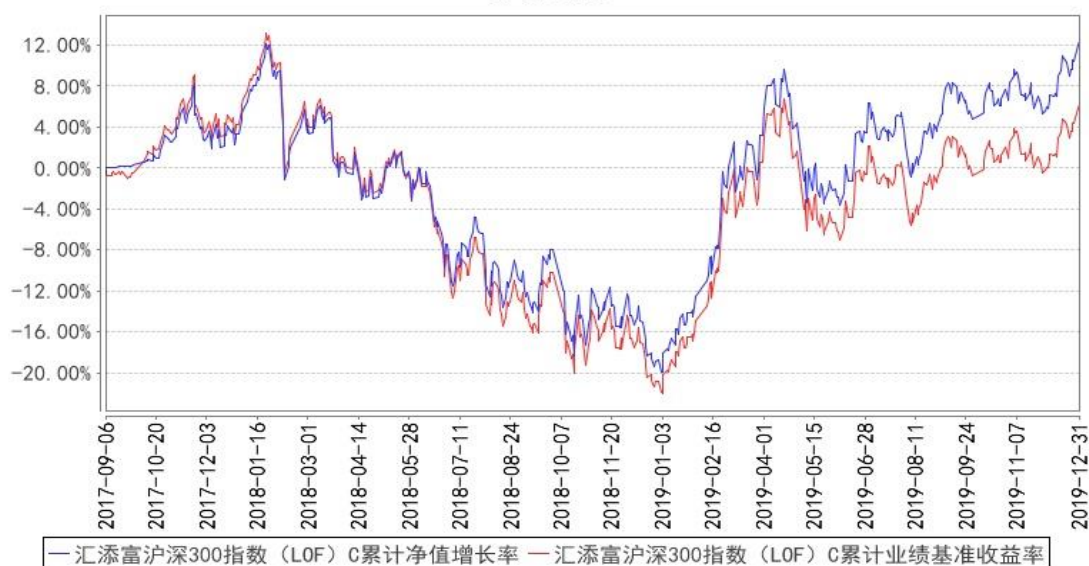
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④    |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 7.35%  | 0.69%     | 7.03%      | 0.70%         | 0.32% | -0.01% |

### 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

汇添富沪深300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



汇添富沪深300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《基金合同》生效之日（2017年9月6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 | 添富沪深300ETF、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。 | 2019年12月31日 | —    | 10年    | 国籍：中国。<br>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。 |
| 楚天舒 | 中证上海国企 ETF、上海国企 ETF 联接、汇添富 | 2017 年 9 月 6 日 | 2019 年 12 月 31 日 | 19 年 | 国籍：中国。学历：南开大学经济学博士。从业经历：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

|  |                                                                            |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--|----------------------------------------------------------------------------|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>沪深 300 指数 (LOF)、汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)、添富沪深 300ETF 的基金经理, 指数与量化投资部副总监。</p> |  |  | <p>曾任职于深圳商业银行、华安证券、华富基金管理公司、深圳证券交易所、上海证券交易所、华宝兴业基金管理公司, 2014 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司, 现任指数与量化投资部副总监。</p> <p>2016 年 8 月 8 日至 2019 年 12 月 31 日任中证上海国企 ETF 的基金经理, 2016 年 9 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任上海国企 ETF 联接的基金经理, 2017 年 9 月 6 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富沪深 300 指数(LOF) 的基金经理, 2017 年 12 月 1 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, 2017 年 12 月 4 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富中证全指证券公司指数 (LOF) 的基金经理, 2019</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                 |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 年 12 月 4 日至 2019 年 12 月 31 日任添富沪深 300ETF 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。

## 4.2 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严格遵守《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，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合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，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内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 11 次。投资

组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度经济增速下行压力仍然较大。从稳增长政策来看，基建托底仍是重要抓手。2019 年下半年财政政策发力明显，国务院允许地方政府将专项债作为项目资本金，并扩大项目范围、下调部分基建项目资本金比例等，带动基建投资增速触底反弹。12 月中央经济工作会议，对 2020 年经济工作的总体要求仍是稳字当头，实现量的合理增长和质的稳步提升。

货币政策方面，2020 年 1 月 1 日，央行宣布为支持实体经济发展，降低社会融资实际成本，决定于 2020 年 1 月 6 日下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点（不含财务公司、金融租赁公司和汽车金融公司）。政策强调定力，不搞大水漫灌，但中长期大概率仍将维持流动性合理充裕，资金利率维持在较低水平。

资本市场改革稳步推进，资本市场的重要性进一步提升。新修订的证券法将于 2020 年 3 月 1 日起开始施行。此次证券法修订从证券发行制度、强化投资者保护、强化信息披露等多方面进行了修订和完善，对打造一个规范、透明、开放、有活力、有韧性的资本市场，具有深远的意义。银保监会发布《中国银保监会关于推动银行业保险业高质量发展的指导意见》，提出要大力发展直接融资市场。银行保险机构要健全与直接融资发展相适应的服务体系，运用多种方式为直接融资提供配套支持，提高直接融资比重。

MSCI 年内最大扩容于 11 月 26 日生效。至此，MSCI 已经以 20% 的因子纳入 A 股大中盘股票。北上资金净流入接近历史高位。

四季度 A 股市场处于震荡上升态势，上证综指年末收于 3050 点。报告期末，沪深 300 指数的市盈率为 12.48，仍处于估值合理区间。

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

截至本报告期末汇添富沪深 300 指数 (LOF) A 基金份额净值为 1.1267 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.42%；截至本报告期末汇添富沪深 300 指数 (LOF) C 基金份额净值为 1.1240 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.35%；同期业绩比较基准收益率为 7.03%。

#### 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               | 210,194,479.20 | 90.34         |
|    | 其中: 股票             | 210,194,479.20 | 90.34         |
| 2  | 基金投资               | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资             | 7,200.00       | 0.00          |
|    | 其中: 债券             | 7,200.00       | 0.00          |
|    | 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       | 20,264,783.78  | 8.71          |
| 8  | 其他资产               | 2,200,932.43   | 0.95          |
| 9  | 合计                 | 232,667,395.41 | 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         | 3,142,137.60  | 1.36          |
| B  | 采矿业              | 6,402,005.52  | 2.77          |
| C  | 制造业              | 88,986,123.07 | 38.50         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,088,784.00  | 2.20          |
| E  | 建筑业              | 5,403,826.76  | 2.34          |
| F  | 批发和零售业           | 2,367,398.96  | 1.02          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 5,809,236.84  | 2.51          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 6,342,958.54  | 2.74          |
| J  | 金融业              | 70,198,298.61 | 30.37         |
| K  | 房地产业             | 9,165,852.83  | 3.97          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 2,523,524.85  | 1.09          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,046,483.20  | 0.45          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 223,440.00    | 0.10          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -             |
| P  | 教育               | 187,740.00    | 0.08          |

|   |           |                |       |
|---|-----------|----------------|-------|
| Q | 卫生和社会工作   | 1,881,274.43   | 0.81  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,094,971.42   | 0.47  |
| S | 综合        | —              | —     |
|   | 合计        | 209,864,056.63 | 90.80 |

### 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              | 165,691.49 | 0.07          |
| 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           | —          | —             |
| 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       | 158,153.04 | 0.07          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 6,578.04   | 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               | 330,422.57 | 0.14          |

### 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股票投资。

## 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  | 601318 | 中国平安 | 167,100 | 14,280,366.00 | 6.18          |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 7,700   | 9,109,100.00  | 3.94          |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 161,200 | 6,057,896.00  | 2.62          |
| 4  | 000651 | 格力电器 | 73,900  | 4,846,362.00  | 2.10          |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 227,300 | 4,500,540.00  | 1.95          |

|    |        |       |         |              |      |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 6  | 000333 | 美的集团  | 75,000  | 4,368,750.00 | 1.89 |
| 7  | 600276 | 恒瑞医药  | 47,569  | 4,163,238.88 | 1.80 |
| 8  | 000858 | 五 粮 液 | 29,801  | 3,963,831.01 | 1.71 |
| 9  | 600030 | 中信证券  | 117,300 | 2,967,690.00 | 1.28 |
| 10 | 600887 | 伊利股份  | 93,734  | 2,900,129.96 | 1.25 |

### 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  | 688128 | 中国电研 | 9,027  | 158,153.04 | 0.07          |
| 2  | 688300 | 联瑞新材 | 3,164  | 126,053.76 | 0.05          |
| 3  | 002972 | 科安达  | 1,075  | 21,532.25  | 0.01          |
| 4  | 603109 | 神驰机电 | 684    | 18,105.48  | 0.01          |
| 5  | 002973 | 侨银环保 | 1,146  | 6,578.04   | 0.00          |

### 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  | 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) | 7,200.00 | 0.00          |
| 8  | 同业存单       | —        | —             |
| 9  | 其他         | —        | —             |
| 10 | 合计         | 7,200.00 | 0.00          |

### 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  | 128088 | 深南转债 | 72     | 7,200.00 | 0.00          |

### 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<br>(元) | 风险说明       |
|--------------------|--------|-----------|--------------|---------------|------------|
| IF2003             | IF2003 | 3         | 3,707,820.00 | 189,855.00    | -          |
| IF2006             | IF2006 | 4         | 4,939,680.00 | 331,860.00    | -          |
| 公允价值变动总额合计 (元)     |        |           |              |               | 521,715.00 |
| 股指期货投资本期收益 (元)     |        |           |              |               | 120,684.47 |
| 股指期货投资本期公允价值变动 (元) |        |           |              |               | 666,255.00 |

### 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,充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等,以降低交易成本和组合风险,提高投资效率。

## 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   | 1,038,656.27 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 9,767.15     |
| 5  | 应收申购款   | 1,152,509.01 |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 6 | 其他应收款 | —            |
| 7 | 待摊费用  | —            |
| 8 | 其他    | —            |
| 9 | 合计    | 2,200,932.43 |

#### 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明细。

#### 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

| 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  | 688128 | 中国电研 | 158,153.04      | 0.07          | 新股流通受限   |
| 2  | 688300 | 联瑞新材 | 126,053.76      | 0.05          | 新股流通受限   |
| 3  | 002973 | 侨银环保 | 6,578.04        | 0.00          | 新股流通受限   |

## §6 开放式基金份额变动

单位: 份

| 项目                         | 汇添富沪深 300 指数 (LOF)<br>A | 汇添富沪深 300 指数 (LOF)<br>C |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 报告期期初基金份额总额                | 183,521,503.78          | 104,638,738.85          |
| 报告期期间基金总申购份额               | 25,422,516.50           | 41,921,789.20           |
| 减:报告期期间基金总赎回份额             | 80,832,773.86           | 69,342,500.47           |
| 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                | 128,111,246.42          | 77,218,027.58           |

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

单位: 份

| 项目               | 汇添富沪深 300 指数 (LOF)<br>A | 汇添富沪深 300 指数 (LOF)<br>C |
|------------------|-------------------------|-------------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,002,700.27           | —                       |
| 报告期期间买入/申购总份额    | 0.00                    | —                       |
| 报告期期间卖出/赎回总份额    | 0.00                    | —                       |

|                           |               |   |
|---------------------------|---------------|---|
| 报告期期末管理人持有的本基金份额          | 10,002,700.27 | — |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 7.81          | — |

注:本基金于 2017 年 9 月 6 日成立。本公司于 2017 年 8 月 28 日用自有资金 10,001,000.00 元认购本基金份额 10,002,700.27 份 (含募集期利息结转的份额), 认购费用 1,000.00 元。符合招募说明书规定的认购费率。

## 7.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内管理人未运用自有资金投资本基金。

## § 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 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人自有资金   | 10,002,700.27 | 4.87            | 10,002,700.27 | 4.87            | 3 年        |
| 基金管理人高级管理人员 | 50,653.43     | 0.02            | —             | —               | —          |
| 基金经理等人员     | —             | —               | —             | —               | —          |
| 基金管理人股东     | —             | —               | —             | —               | —          |
| 其他          | 602,058.91    | 0.29            | —             | —               | —          |
| 合计          | 10,655,412.61 | 5.19            | 10,002,700.27 | 4.87            | 3 年        |

## § 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沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 募集的文件;
- 2、《汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- 3、《汇添富沪深 300 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、报告期内汇添富沪深 300 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](http://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 1 月 21 日