汇添富沪深 300 基本面增强指数型证券投资 基金 2022 年第 1 季度报告

2022年03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

送出日期: 2022年04月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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 2022 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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 2022年01月01日起至2022年03月31日止。

§2基金产品概况

2.1 基金基本情况

	·
基金简 称	汇添富沪深 300 基本面增强指数
基金主 代码	010854
基金运 作方式	契约型开放式
基金合 同生效 日	2021年01月20日
报告期 末基金 份额总 额(份)	7, 782, 733, 473. 17
投资目标	本基金为股票型指数增强基金,在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上,通过基本面选股方法进行积极的组合管理和风险控制,力求实现超越标的指数的业绩表现。
投资策 略	本基金采用指数增强型投资策略,以沪深 300 指数作为基金投资组合的标的 指数,立足于深入的基本面分析,精选高质量证券组合,力争控制本基金净

	值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%,年跟 踪误差不超过 7.75%,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。 股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资以个股精选策略为主。 在本基金的投资过程中,将控制股票投资组合与标的指数的结构性偏离,以 期在长期实现持续超越标的指数收益率的投资目标。本基金的投资策略还包括:资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、国债期货投资策略。			
业绩比 较基准	沪深 300 指数收益率 * 95% + 活期存款	大利率(税后) *5%		
风险收 益特征	本基金为股票型指数增强基金,其预期 债券型基金、混合型基金。	风险和预期收益高于货币市场基金、		
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	汇添富沪深 300 基本面增强指数 A	汇添富沪深 300 基本面增强指数 C		
下属分 级基金 的交易 代码	010854 010855			
报告期 末下属 分级基 金的份 额总额 (份)	7, 345, 587, 530. 83			

§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(2022年01月01日 - 2022年03月31日)		
	汇添富沪深 300 基本面增强指数	汇添富沪深 300 基本面增强指	
	A	数 C	
1. 本期已实现收益	-419, 997, 332. 60	-25, 431, 659. 19	
2. 本期利润	-1, 142, 521, 725. 11	-67, 795, 886. 90	
3. 加权平均基金份	0.1591	0.1599	
额本期利润	-0. 1521	-0. 1522	

4. 期末基金资产净 值	5, 370, 576, 878. 60	316, 575, 011. 86
5. 期末基金份额净 值	0. 7311	0.7242

- 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 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 基本面	增强指数 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. 15%	1. 40%	-13.83%	1.39%	-3.32%	0.01%
过去六 个月	-17. 49%	1. 13%	-12. 57%	1.11%	-4. 92%	0. 02%
过去一	-16.90%	1.18%	-15.53%	1. 08%	-1.37%	0.10%
自基金 合同生 效日起 至今	-26 . 89%	1. 26%	-21. 26%	1. 16%	-5. 63%	0. 10%
		汇添富沪	深 300 基本面	增强指数 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	1-3	2-4
过去三 个月	-17. 30%	1. 40%	-13.83%	1.39%	-3.47%	0.01%
过去六 个月	-17. 82%	1. 13%	-12.57%	1.11%	-5. 25%	0. 02%
过去一	-17. 55%	1. 18%	-15. 53%	1. 08%	-2. 02%	0.10%
自基金 合同生 效日起	-27. 58%	1. 26%	-21. 26%	1.16%	-6.32%	0.10%

- $+$ $+$ $+$ $+$			
<u> </u>			

3. 2. 2 自基金合同生效以来基金份额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基本面增强指数A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图





汇添富沪深300基本面增强指数C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2021年01月20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
姓石	駅 第	任职日期	离任日期	(年)	近 9月
顾耀强	本基金的基 金经理,增 强收益部总 监	2021年01月 20日		18	国国清理从证金格历州公员券公籍。华学业券从。 : 永司、股司中历学士格资资业任集术通有业行生等。 : 基 经杭团 证限分

析师、中海有限公司而,基金公司而,以为分析理的。 2009 年 3 月加入汇添 高基金经 7 月 2009 年 3 月加入汇添 高基金 7 月 200 年 3 月 200 年 3 月 200 年 2 月 200 年 2 年 3 月 9 年 2 200 年 9 月 3 日任投资 4 年 4 月 8 日至 2014 年 4 月 8 日至 2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日 任汇添 1 2 均 後 增 证 4 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年 1 年			
限分析經期 建全型099年 3月加入汇準 服份, 1月加入汇準 服份, 1月加入汇率 2009年 1月加入汇率 2009年 200年 200年 2009年 200年 2009年 200年 2012年 2012年 2012年 2012年 2014年 2016年 2016年 2019年 201			析师、中海
分析死理助 理。2009 年 3 月加入汇漆 富基金原任高 级行,历业分金。现 行成少分金。现 在海总监 年 2 月 22 日 至 今年 四世境监 年 2 月 22 日 至 今年 回报按基金的。2012 年 3 月 9 日 至 9 月 3 日 在 知 资基 金经 理。2014 年 4 月 8 日 至 2014 年 4 月 8 日 至 2016 年 8 月 24 日 任工增证券的基金 经理。2016 年 7 月 27 日 至 2019 年 1 第 日 年 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 至 2 日 9 年 1 月 18 日 任 江 深富价值 许多的基金 经理。2017			基金管理有
金经理助理。2009年3月加入汇添富基金管理股份有任务。			限公司高级
理。2009年3月加入汇添富基份有风信。 月加入汇添富基份有风信高级价,行业有金额,有少全处理助理操业。 2009年12月空209年12月空209年12月空200年13月9日9月3日在汇漆港水水。 2009年12月空2020年3月9日9月3日在汇资券投资券收入。 2014年4月8日至2016年8月24日在汇增长投资。 2014年4月8日至2016年7月27日 至2019年1月18日在汇滞添价价类投资基金的。 2016年7月27日 至2019年1月18日在汇添添价价类投资基金的。 2016年7月2019年1月月18日在汇添添价价类投资基金。 2017			分析师、基
3月加入汇添富基金便理 股份,历任高级人工。 一个工作,是一个工作。 一个工作,是一个工作。 一个工作,是一个工作。 一个工作,是一个工作,是一个工作。 一个工作,是一个工作,也可以工作,也可以工作,一个工作,也可以一个工作,也可以一个一个工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可以工作,也可			金经理助
富基金管理股份有限公司,仍任分金额。			理。2009年
股份有限公司,历任高级行业分析师、基金经理助理,现任增强收益部总监。2009年12月22日至今唯一汇添富策。 2009年12月22日至今婚回报报资基金的基金经理。2012年3月9日至2020年9月3日任汇资混合型证券投资基金经理。2014年4月8日至2016年8月24日在汇资格处理。2014年2日年汇资格处理证券投资基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添高产量工作发资的基础经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添高产量工作发资的基础条件。2017			3月加入汇添
司,历任高级行业分析 师、基金经理 助理,现 任增总监。 2009 年 12 月 22 日至今任 汇添 6 整 回报 混合 6 整 回报 混合 6 基 6 型 证券 投金经 理。 2012 年 3 月 9 日至 2020 年 9 月 3 日任汇资 高 道向型证券 投资基金的基金经理。 2014 年 4 月 8 日至 2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月2 日 任汇 6 卷 7 月 27 日 至 2019 年 1 月 18 日任汇 添高 沪 地深 新价值 股票 型证券 投资基金的基金经理。 2017			富基金管理
级行业分析师、基金经理助理,现任增强收益部总监。2009年12月22日至今任汇添属企型证券投资基金的基金经理。2012年3月9日至2020年9月3日任投资混合型证券投资基金的基金经理。2014年4月8日至2016年8月24日任汇添高的基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添高沪港涨新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017			股份有限公
师、基金经理助理,现任增强收益部总监。2009年12月22日至今任汇添高策略回报完合型证券投资基金的基金全理。2012年3月9日至2020年9月3日任汇资税合型证券投资基金理。2014年4月8日至2016年8月24日任汇率,1000年10日年8月24日任汇率,1000年10日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票,型证券投资基金的基金经理。2017			司,历任高
理助理,现任增强收益部总监。 2009年12月 22日至今年汇添富合型证券投资基金的基金经理。2012年3月9日至 2020年9月3日任汇资润向设证券投资基金的基金经理。2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富混合型证券投资基金的基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港级资基金的基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富的基金经理。2017			级行业分析
任增强收益 部总监。 2009年12月22日至今任 汇添富策略 回报混合型 证券基金约基金经理。2012年3月9日至 2020年9月3日任投资股 合型证券投资基金的基金经理。 2014年4月8日至2016年8月24日任汇添高均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。 2016年7月27日至 2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017			师、基金经
部总监。 2009 年 12 月 22 日至今任 汇添富策略 回报混合型 证券投金经 理。2012 年 3 月 9 日至 2020 年 9 月 3 日任汇资表投资基金的基金经理。 2014 年 4 月 8 日至 2016 年 7 月 27 日 至 2016 年 7 月 27 日 至 2019 年 1 月 18 日任汇添高价值股票 型证券投资基金的基金 经理。2017			理助理,现
2009 年 12 月 22 日至今任 汇添富策略 回报混合型 证券投资基金的基金经 理。2012 年 3 月 9 日至 2020 年 9 月 3 日任汇添混 6 型证券投资基金的基金经理。2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日任汇添混 6 型证券投资基金的基金经理。2016 年 7 月 27 日至 2019 年 1月 18 日任汇 添富沪港深 新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017			任增强收益
22 日至今任 汇添富策略 回报混合型 证券投资基 金的基金经理。2012年 3月9日至 2020年9月 3日任汇添混 合型证券投资基金的基金 经理。 2014年4月 8日至 2016年8月24日 任汇添混合型证券投资基金的基金 经理。2016年7月27日 至2019年1月18日任汇 添富沪港深 新价值股票 型证券投资基金的基金 经理。2017			部总监。
汇添富策略 回报混合型 证券投资基金的基金经理。2012年3月9日至2020年9月3日任汇添混。 如向投资混合型证券投资基金的基金经理。2014年4月8日至2016年8月24日任汇添高混为衡增长投资基金。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添高沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017			2009年12月
回报混合型证券投资基金的基金经理。2012年3月9日至2020年9月3日任汇添混产量上,2014年4月3日在汇本,2014年4月8日至2016年8月24日任汇添混合型证券投资基金的基金经型。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017			22 日至今任
证券投资基金的基金经理。2012年3月9日至2020年9月3日任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。2014年4月8日至2016年8月24日任汇添高的基金的基金的基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017			汇添富策略
金的基金经理。2012年3月9日至2020年9月3日任汇添富 逆向投资混 合型证券投资基金的基金经理。2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富均 衡增长混合型证券投资基金的基金 经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金 经理。2017			回报混合型
理。2012年3月9日至2020年9月3日任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017			证券投资基
3月9日至2020年9月3日任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017			金的基金经
2020 年 9 月 3 日任汇添富 逆向投资混 合型证券投 资基金的基 金经理。 2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日 任汇添富均 衡增长混合 型证券投资 基金的基金 经理。2016 年 7 月 27 日 至 2019 年 1 月 18 日任汇 添富沪港深 新价值股票 型证券投资 基金的基金 经理。2017			理。2012年
3 日任汇添富 逆向投资混 合型证券投 资基金的基 金经理。 2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日 任汇添富均 衡增长混合 型证券投资 基金的基金 经理。2016 年 7 月 27 日 至 2019 年 1 月 18 日任汇 添富沪港深 新价值股票 型证券投资 基金的基金 经理。2017			3月9日至
逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。 2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017			2020年9月
合型证券投资基金的基金经理。 2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017			3 日任汇添富
资基金的基金经理。 2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017			逆向投资混
金经理。 2014年4月 8日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017			合型证券投
2014年4月 8日至2016 年8月24日 任汇添富均 衡增长混合 型证券投资 基金的基金 经理。2016 年7月27日 至2019年1 月18日任汇 添富沪港深 新价值股票 型证券投资 基金的基金 经理。2017			资基金的基
8 日至 2016 年 8 月 24 日 任汇添富均 衡增长混合 型证券投资 基金的基金 经理。2016 年 7 月 27 日 至 2019 年 1 月 18 日任汇 添富沪港深 新价值股票 型证券投资 基金的基金 经理。2017			金经理。
年8月24日 任汇添富均 衡增长混合型证券投资 基金的基金 经理。2016 年7月27日 至2019年1 月18日任汇 添富沪港深 新价值股票 型证券投资 基金的基金 经理。2017			2014年4月
任汇添富均 衡增长混合 型证券投资 基金的基金 经理。2016 年7月27日 至2019年1 月18日任汇 添富沪港深 新价值股票 型证券投资 基金的基金 经理。2017			8 日至 2016
 衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017 			年8月24日
型证券投资基金的基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017			任汇添富均
基金的基金 经理。2016 年7月27日 至2019年1 月18日任汇 添富沪港深 新价值股票 型证券投资 基金的基金 经理。2017			衡增长混合
经理。2016 年7月27日 至2019年1 月18日任汇 添富沪港深 新价值股票 型证券投资 基金的基金 经理。2017			型证券投资
年7月27日 至2019年1 月18日任汇 添富沪港深 新价值股票 型证券投资 基金的基金 经理。2017			基金的基金
至 2019 年 1 月 18 日任汇 添富沪港深 新价值股票 型证券投资 基金的基金 经理。2017			经理。2016
月 18 日任汇 添富沪港深 新价值股票 型证券投资 基金的基金 经理。2017			年7月27日
添富沪港深 新价值股票 型证券投资 基金的基金 经理。2017			至 2019 年 1
新价值股票型证券投资基金的基金 经理。2017			月 18 日任汇
型证券投资 基金的基金 经理。2017			添富沪港深
基金的基金 经理。2017			新价值股票
经理。2017			型证券投资
			基金的基金
年 3 月 15 日			经理。2017
	 	 	 年3月15日

		至今任汇添
		富绝对收益
		策略定期开
		放混合型发
		起式证券投
		资基金的基
		金经理。
		2019年8月
		24 日至今任
		汇添富均衡
		增长混合型
		证券投资基
		金的基金经
		理。2021年
		1月20日至
		今任汇添富
		沪深 300 基
		本面增强指
		数型证券投
		资基金的基
		金经理。
		2021年2月
		5 日至今任汇
		添富价值成
		长均衡投资
		混合型证券
		投资基金的
		基金经理。
		2021年9月
		16 日至今任
		汇添富中证
		500 基本面增
		强指数型证
		券投资基金
		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"离任日期"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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期內遵守《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

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

- 一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程,以确保公平交易管控覆盖公司 所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。
- 二、本着"时间优先、价格优先"的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统中的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。
- 三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上,本基金管理人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,本基金管理人管理的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 7 次,投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控,事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析,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

一季度 A 股市场遭遇内外"黑天鹅"的双重打击, 总体大幅下跌。仅部分受益于通胀和

稳增长预期的煤炭、地产等行业表现较好;而去年表现优异的高景气赛道如新能源、半导体和军工等则调整较多;消费相关行业也在疫情隐忧下延续疲软态势。一季度本基金在选股超额难度较大的背景下选择了阶段性降低组合的偏离度。但本基金管理人仍坚信基本面优质公司长期战胜指数的确定性,投资上会继续依托公司投研团队的选股优势,立足基本面研究,不断优化投资组合,力争在控制好跟踪误差的基础上获取较高的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为-17.15%; C 类基金份额净值增长率为-17.30%。同期业绩比较基准收益率为-13.83%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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	5, 190, 877, 412. 96	90. 95
	其中: 股票	5, 190, 877, 412. 96	90. 95
2	基金投资		_
3	固定收益投资	70, 507, 028. 17	1.24
	其中:债券	70, 507, 028. 17	1.24
	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	431, 797, 144. 55	7. 57
8	其他资产	14, 428, 594. 21	0. 25
9	合计	5, 707, 610, 179. 89	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	55, 855, 773. 28	0.98
В	采矿业	164, 001, 265. 00	2. 88
С	制造业	2, 511, 966, 195. 0 1	44. 17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	123, 187, 611. 13	2. 17
Е	建筑业	103, 284, 916. 78	1.82
F	批发和零售业	36, 276, 494. 00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	108, 799, 955. 10	1.91
Н	住宿和餐饮业	-	-
Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	118, 030, 305. 69	2.08
J	金融业	1,021,922,480.0	17. 97
K	房地产业	111, 884, 595. 00	1. 97
L	租赁和商务服务业	46, 836, 907. 95	0.82
M	科学研究和技术服务业	114, 094, 776. 00	2.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
0	居民服务、修理和其他服务业	-	_
Р	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	35, 496, 655. 05	0.62
R	文化、体育和娱乐业	9, 371, 191. 00	0.16
S	综合	_	
	合计	4, 561, 009, 120. 9 9	80. 20

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	_	_
В	采矿业	73, 897, 514. 00	1.30
С	制造业	501, 213, 396. 18	8. 81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	_	=
Е	建筑业	7, 110. 12	0.00
F	批发和零售业	306, 040. 55	0. 01
G	交通运输、仓储和邮政业	16, 541. 00	0.00
Н	住宿和餐饮业	9, 292. 80	0.00
Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	34, 848, 598. 12	0. 61
Ј	金融业	15, 840, 000. 00	0.28
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	3, 561, 290. 68	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	_	-
0	居民服务、修理和其他服务业	_	-
Р	教育	_	-
Q	卫生和社会工作	168, 508. 52	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	_
S	综合	_	_
	合计	629, 868, 291. 97	11.08

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
- 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	153, 572	263, 990, 268. 00	4.64
2	300750	宁德时代	320,006	163, 939, 073. 80	2.88
3	600036	招商银 行	3, 386, 897	158, 506, 779. 60	2.79
4	601318	中国平安	2, 500, 059	121, 127, 858. 55	2. 13
5	601166	兴业银 行	5, 389, 200	111, 394, 764. 00	1.96
6	601012	隆基股 份	1, 323, 858	95, 569, 309. 02	1.68
7	603259	药明康 德	830, 800	93, 365, 304. 00	1.64
8	300122	智飞生 物	667, 100	92, 059, 800. 00	1.62
9	600030	中信证券	3, 893, 185	81, 367, 566. 50	1.43
10	000001	平安银行	5, 000, 044	76, 900, 676. 72	1.35

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

		股票名			占基金资产
序号	股票代码	秋 秋	数量(股)	公允价值 (元)	净值比例
		1711			(%)

1	002100	天康生 物	3, 500, 000	42, 595, 000. 00	0.75
2	603290	斯达半 导	106, 300	41, 095, 580. 00	0.72
3	000983	山西焦煤	3,000,000	37, 260, 000. 00	0.66
4	300502	新易盛	1,099,939	34, 318, 096. 80	0.60
5	002603	以岭药业	1,000,040	33, 501, 340. 00	0.59

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	41, 840, 217. 26	0.74
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)	28, 666, 810. 91	0. 50
8	同业存单	_	_
9	地方政府债	_	_
10	其他	_	_
11	合计	70, 507, 028. 17	1. 24

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	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	019654	21 国债 06	320,000	32, 718, 150. 14	0.58
2	113050	南银转	89, 910	10, 734, 995. 36	0.19

		债			
3	019658	21 国债	90,000	9, 122, 067. 12	0.16
J	019036	10	90,000	9, 122, 007. 12	0.10
4	113641	华友转	38, 600	4, 649, 979. 14	0.08
4	113041	债	36,000	4, 049, 979. 14	0.08
E	110005	通 22 转	10 900	2 520 256 46	0.04
5	110085	债	19, 800	2, 530, 356. 46	0.04

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投资。
- 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	风险说明
IF2206	IF2206	80.00	100, 425, 600. 00	-1, 969, 749. 37	
	-1, 969, 749. 37				
股指期货投资本期收益 (元)					-1, 947, 356. 48
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-1, 969, 749. 37

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金按照风险管理的原则,以套期保值为目的,参与股指期货交易。本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。基金管理人将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;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后执行。若相关法律法规发生变化时,基金管理人股指期货投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

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中,南京银行股份有限公司、成都银行股份有限公司、长城汽车股份有限公司、牧原食品股份有限公司、山西焦煤能源集团股份有限公司、招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、平安银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5. 11. 2

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	14, 169, 048. 16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	_

4	应收利息	_
5	应收申购款	259, 546. 05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	14, 428, 594. 21

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净 值比例(%)
1	113050	南银转债	10, 734, 995. 36	0.19
2	127038	国微转债	2, 093, 008. 97	0.04
3	113049	长汽转债	1, 783, 017. 62	0.03
4	127045	牧原转债	1, 168, 563. 82	0.02
5	113627	太平转债	1, 153, 864. 03	0.02
6	123104	卫宁转债	523, 334. 16	0.01

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

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6开放式基金份额变动

单位: 份

项目	汇添富沪深 300 基本面增强指数 A	汇添富沪深 300 基本面增强指数 C
本报告期期初基金 份额总额	7, 657, 767, 337. 43	449, 995, 821. 49
本报告期基金总申 购份额	51, 991, 225. 56	16, 532, 523. 97
减:本报告期基金总赎回份额	364, 171, 032. 16	29, 382, 403. 12
本报告期基金拆分 变动份额	_	_

本报告期期末基金 份额总额	7, 345, 587, 530. 83	437, 145, 942. 34
仍欲心欲		

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:本基金的基金管理人本报告期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:本基金的基金管理人本报告期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者超过 20%的情况

注:无

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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沪深 300 基本面增强指数型证券投资基金募集的文件:
- 2、《汇添富沪深 300 基本面增强指数型证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富沪深 300 基本面增强指数型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 基本面增强指数型证券投资基金在规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

上海市黄浦区外马路 728 号 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 2022年04月22日