

汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

2017 年第 4 季度报告

2017 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：2018 年 1 月 22 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 2018 年 1 月 18 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 2017 年 10 月 1 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）
交易代码	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	141,619,224.54 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。
业绩比较基准	沪深 300 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，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	86,997,683.61 份	54,621,540.93 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（2017年10月1日—2017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	2,131,812.00	1,779,579.10
2. 本期利润	4,106,957.50	4,326,037.15
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0376	0.0473
4. 期末基金资产净值	89,833,296.90	56,403,805.31
5. 期末基金份额净值	1.0326	1.0326

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

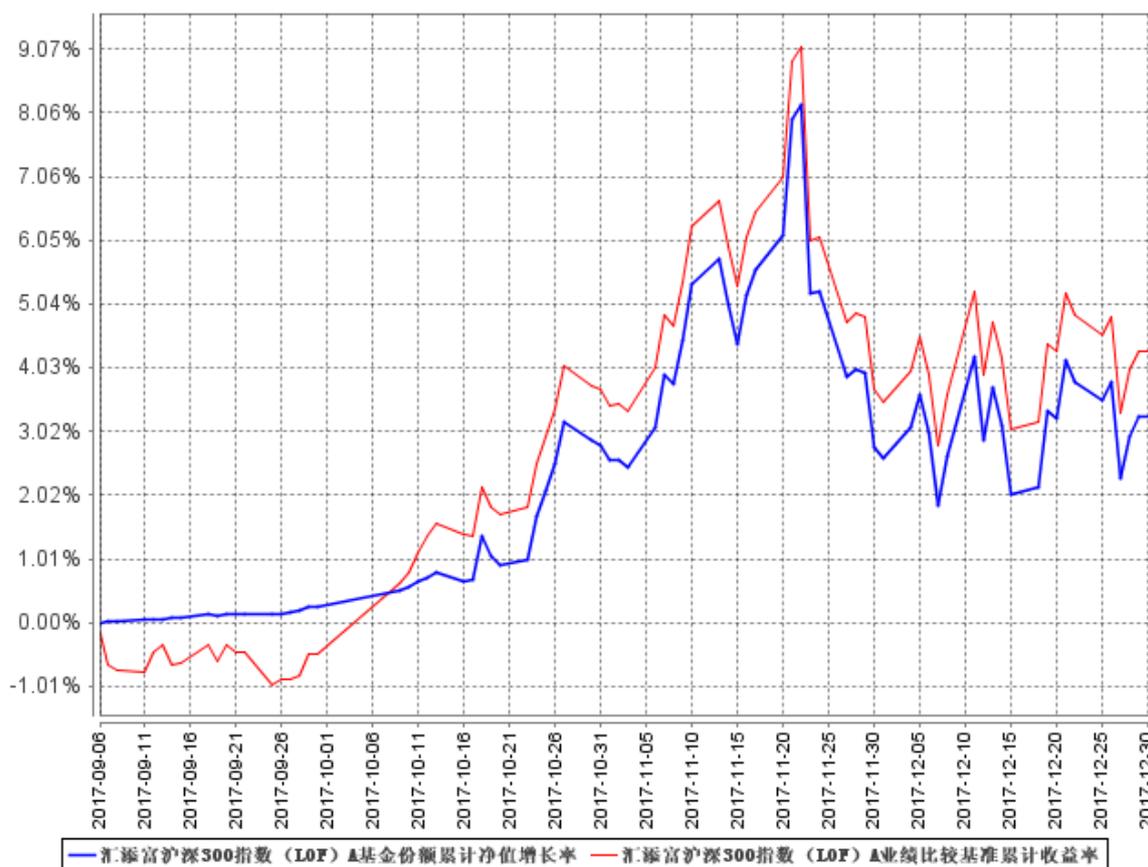
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.99%	0.75%	4.82%	0.76%	-1.83%	-0.01%

汇添富沪深 300 指数 (LOF) C

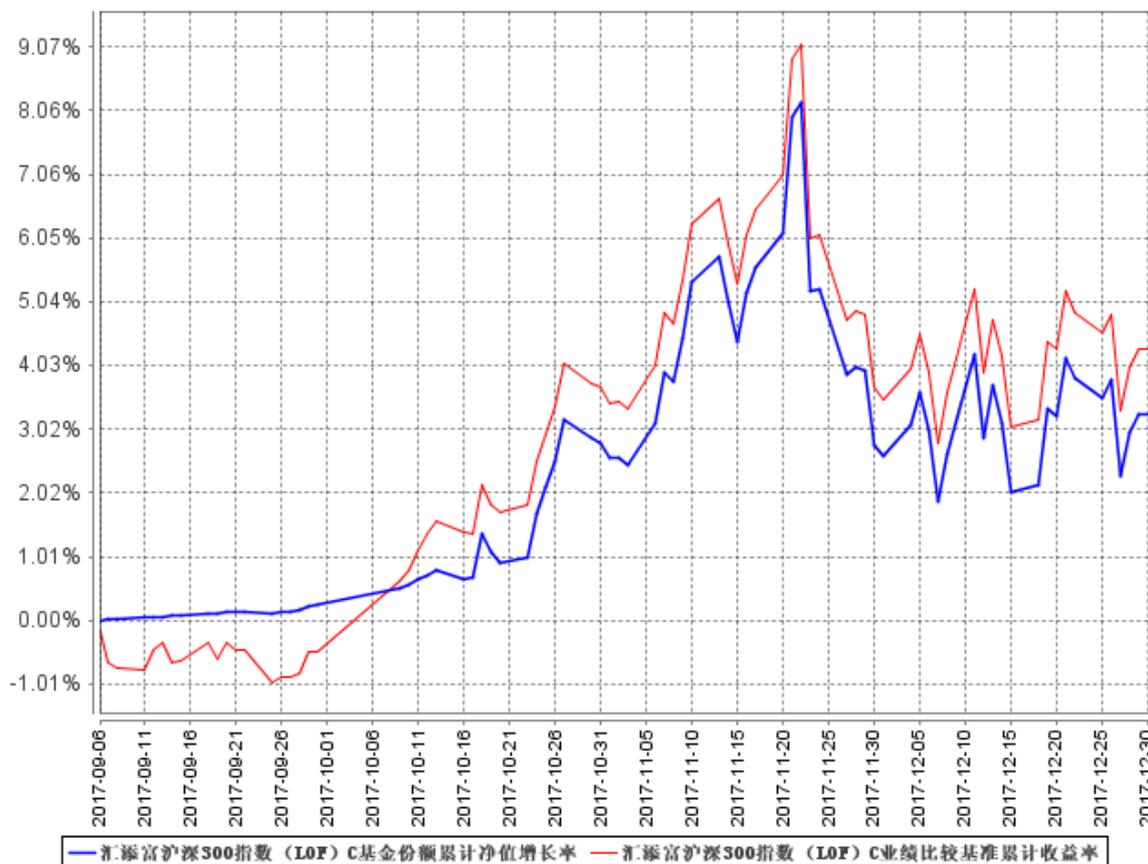
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.01%	0.75%	4.82%	0.76%	-1.81%	-0.01%

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基金份额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基金份额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《基金合同》生效之日为 2017 年 9 月 6 日，截至本报告期末，基金成立未满一年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017 年 9 月 6 日）起 6 个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓中。

§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		
楚天舒	中证上海国企 ETF、上海国企 ETF 联接、汇添富沪深 300 指数 (LOF)、上证上海改革发展主题 ETF、汇添富中证全指证券公司指数 (LOF) 的基金经理，指数与量化投资部副总监。	2017 年 9 月 6 日	-	17 年	国籍：中国。学历：南开大学经济学博士。从业经历：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。2016 年 8 月 8 日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理，2016 年 9 月 18 日至今任上海国企 ETF 联接的基金经理，2017 年 9 月 6 日至今任汇添富沪深 300 指数 (LOF) 的基金经理，2017 年 12 月 1 日至今担任上证上海改革发展主题 ETF 的基金经理，2017 年 12 月 4 日至今担任汇添富中证全指证券公司指数 (LOF) 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

本报告期内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总成交量 5% 的交易次数为 3 次，由于组合投资策略导致，并经过公司内部风控审核。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾四季度。基本上，国际经济继续复苏，贸易维持较高景气度，国内经济延续了稳中向好的态势，出口持续好转。政策面，十九大报告和中央经济工作会议指明了未来发展和改革的方向；金融监管力度增强，持续引导经济去杠杆和资本“脱虚向实”，尽管监管政策对短期市场资金面和流动性有所影响，但着眼未来，确定性的提高和潜在风险的降低提升了权益市场的吸引力。

结构上，受益于经济整体复苏，叠加供给侧改革和环保督察对低效率、高污染的落后产能的挤出，工业品价格上涨，工业企业利润率有所回升；部分周期行业表现出色。消费对经济增长的

拉动作用越来越大，消费者信心指数维持高位，消费升级已成为市场的共识，部分业绩确定性强的消费白马股继续表现出色。北上资金持续流入，国外投资者对 A 股权益资产的配置逐步提升，边际资金的偏好进一步影响了市场风格，加速了 A 股风格国际化的进程。

受经济基本面和资金偏好影响，四季度市场整体上涨但结构分化巨大，沪深 300 上涨 5.07%，中证 500 和中证 1000 分别下跌 5.34%、10.52%。大市值、高盈利、低 PE、内生增长稳健的白马蓝筹公司涨幅较大；与此同时，部分市值较小、盈利能力一般、依赖外延并购实现成长的公司跌幅较大，流动性持续萎缩。

本基金在报告期内遵循了指数基金的投资原则，保持了指数基金的本质属性，严控基金跟踪误差，以期为投资者带来与沪深 300 指数一致的收益。报告期末，本基金 90%以上仓位持有目标指数标的，符合基金合同的要求，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 1.0326 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.99%；截至本报告期末汇添富沪深 300 指数 (LOF) C 基金份额净值为 1.0326 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.01%；同期业绩比较基准收益率为 4.82%。

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	138,766,889.96	94.26
	其中：股票	138,766,889.96	94.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	75,700.00	0.05
	其中：债券	75,700.00	0.05
	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	7,369,897.78	5.01
8	其他资产	1,007,491.71	0.68
9	合计	147,219,979.45	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	326,907.00	0.22
B	采矿业	4,545,658.00	3.11
C	制造业	54,253,701.32	37.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,789,734.00	2.59
E	建筑业	5,424,330.81	3.71
F	批发和零售业	2,624,149.22	1.79
G	交通运输、仓储和邮政业	4,488,978.00	3.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,379,151.94	3.68
J	金融业	47,502,012.51	32.48
K	房地产业	6,364,686.00	4.35
L	租赁和商务服务业	1,645,036.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	921,698.00	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	492,926.13	0.34
R	文化、体育和娱乐业	682,418.40	0.47
S	综合	132,990.00	0.09
	合计	138,574,377.33	94.76

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	采掘业	-	-

C	制造业	174,569.87	0.12
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	17,942.76	0.01
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	192,512.63	0.13

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	601318	中国平安	129,500	9,062,410.00	6.20
2	600519	贵州茅台	5,900	4,115,191.00	2.81
3	600036	招商银行	123,100	3,572,362.00	2.44
4	000333	美的集团	53,700	2,976,591.00	2.04
5	601166	兴业银行	150,000	2,548,500.00	1.74
6	000651	格力电器	57,500	2,512,750.00	1.72

7	600016	民生银行	284,500	2,386,955.00	1.63
8	600887	伊利股份	72,233	2,325,180.27	1.59
9	601328	交通银行	330,100	2,049,921.00	1.40
10	000858	五粮液	22,500	1,797,300.00	1.23

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	600150	中国船舶	3,200	78,944.00	0.05
2	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.03
3	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.02
4	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
5	603329	上海雅仕	1,182	17,942.76	0.01

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)	75,700.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	75,700.00	0.05

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	128024	宁行转债	667	66,700.00	0.05
2	110042	航电转债	90	9,000.00	0.01

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

注：本基金本报告期末无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

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	150,509.41
2	应收证券清算款	652,702.07
3	应收股利	-
4	应收利息	3,593.53
5	应收申购款	200,686.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,007,491.71

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	600150	中国船舶	78,944.00	0.05	重大资产重组停牌
2	002919	名臣健康	28,948.46	0.02	重大事项停牌
3	603161	科华控股	20,753.25	0.01	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富沪深 300 指数 (LOF) A	汇添富沪深 300 指数 (LOF) C
报告期期初基金份额总额	215,858,430.00	296,965,046.78
报告期期间基金总申购份额	9,717,536.78	23,174,724.07
减:报告期期间基金总赎回份额	138,578,283.17	265,518,229.92
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	86,997,683.61	54,621,540.93

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

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	-
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	10,002,700.27
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	7.06

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 基金管理人运用固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
基金管理人固有 资金	10,002,700.27	7.06	10,002,700.27	7.06	3 年
基金管理人高级 管理人员	-	-	-	-	-

基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	123,085.90	0.09	-	-	-
合计	10,125,786.17	7.15	10,002,700.27	7.06	-

§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 21 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

2018 年 1 月 22 日