汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资 基金 2019 年第 3 季度报告

2019年09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: 2019年10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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2019 年 10 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 2019 年 7 月 1 日起至 2019 年 9 月 30 日止。

§2基金产品概况

基金简称	汇添富沪深 300 安中指数
基金主代码	000368
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月6日
报告期末基金份额总额	214, 001, 487. 54 份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪沪深300安中动态策略指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,以便为投资者带来长期收益。
投资策略	主要采取完全复制法。在正常市场情况下,本基金力争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 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	沪深 300 安中动态策略指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款 基准利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型指数基金,在证券投资基金中属于较高预期风险、 较高预期收益的品种,本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表 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	中国工商银行股份有限公司

§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7月1日-2019年9月30日)	
----------------------------------	--

1. 本期已实现收益	11, 587, 403. 13
2. 本期利润	8, 870, 942. 89
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0405
4. 期末基金资产净值	325, 811, 137. 59
5. 期末基金份额净值	1. 5225

- 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	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. 69%	0.97%	1.57%	0. 98%	1. 12%	-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安中指数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



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年11月6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

机大	TITI A	任本基金的	基金经理期限	77半月川,左四) H n n
姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
吴振翔	汇综汇30数添因金主匠金中指中企富网(添50(富子富角富角的理量副添合添0基富子、要F、证数证E中医LC富0LG价股中E中E基,化总富指富安金成股汇消联汇精基上下证疗)中指了值票证下证F金指投监上数沪中、长票添费接添准金海汇互指、证数、多、长汇长联经数资。证、深指汇多基富 基富医、国添联数汇 添因添三添三接 与部	2013年11月6日		13 年	国学学理关证从业长有工上管产经3富份历高量析理指资20日富数经920日证金理月20日籍历技学业券业经盛限程投理品理月基有任级投师助数部10至上基理月13任3的,28年11年,术博务投资历基公研摩有开。加金限产经资、理与副年今证金,16年汇60基20日年汇中中大士资资格:金司究根限发20入管公品理高基,量总2任综的20日11添订金11至11。国国学。格基。曾管金员基公高8添理司开、级金现化监月汇合基11至月富基经年月高县41年,16年,16年,16年,16年,16年,16年,16年,16年,16年,1

证 300FTF 基金 金球 全型 2013 年8 月23 日至 2015 年 11 月2 日任中 证主要消费 ETF 基金、中 证医药卫生 ETF 基金、中 证 医			
基金经理, 2013年8月23日至2015年 11月2日任中证主要消费 ETF 基金、中证医药下生 ETF 基金、中证医药下生 ETF 基金、中证的 基金、中证的 基金、中证的 基金。 中国 全年 11月 1月 1月 1月 1月 1月 1月 1月 1日 1月			证 300ETF 基
2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中 证主要消费 ETF 基金、中 证医药卫生 ETF 基金、中 证修源 ETF 基金 。 中 正 整			金联接基金的
日至 2015 年 11 月 2 日任中 证主要消费 ETF 基金、中 证例源 ETF 基金、中 证例源 ETF 基金、中 证例源 ETF 基金 。中 证验基金 的基金经理, 2013 年 11 月 6 日至今任汇 富定济致基础 2015年 2 月 16 日至今任区因子 股票基理,2015 年 3 月 24 日至 今任汇海官政 接基金的基金经理, 2015年 7 日7 2 日至 全任汇海官联接基金的基金经理,2016年 1月 21 日至今任汇海官中 指推医指数基金的基金经理,2016年 1月 28 日至今任汇海官中证上海基金的基金经理,2016年 1月 28 日至今任中证上周基金年 12 月 28 日至今任中证上周基金年 12 月 26 日至 今任汇海区财产的基金经理,2016年 11 月 28 日至 9任汇海区财产的基金经理,2017年8月 10 基金经理,			基金经理,
11月2日任中 证主要消费 ETF基金、中 证医药卫牛 ETF基金、中 证医药卫牛 ETF基金、中证金融。 的基金经理。 2013年1月6 日至今任江海安 高沙溪 300安 中指数建理。 2015年2月16 日至大长金的 基金公理。 2015年2月16 日至大长金的基金。 3月24日至 今任江海百时联 接处理,2015年3月24日至 今任江海路金的基金。 4月21日至今任江海路金的基金。 5月21日至今任江海路金。 2016年7月28日至南 全区下的基金。 经理,2016年7月28日至南 全区TF的基金。 经理,2016年7月28日至 今任江海路。			2013年8月23
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 证能源 ETF 基金。 中国证据 是一个证证。 管面对 是一个任元添 高沙深 基金的 是一个任元添 高成子 股票基处。 2015年2月16 日至今任元。 是理,2015年3月24日至 今任汇添 ETF 装基金 经理,2016年1月21日中证 精准医金处理,2016年7月28日至今 任工证 精准医金处理,2016年7月28日至今 任中证上海基金 经理,2016年7月28日至今 任中证上海基金 经理,2016年7月28日至今			日至 2015 年
医TF 基金、中证医药卫生 ETF 基金、中证 医药卫生 ETF 基金、中证能源 ETP 基金、			11月2日任中
证医药卫生 ETF 基金、中 证能源 ETF 基金、中 证能源 ETF 基金、中 证金融 地产 ETF 基础。 的基基全 的基本经理, 2013年11月6 日至今任汇添 富沪深 300金的 基金经理, 2015年2月16 日至今多日 2015年3月24日至 今任汇添 1月21日至中 证据医指数垒 理理,2016年今 日汇 2016年今 日汇 2016年今 日汇 2016年9日 全 ETF 月28日至今 至 1月22日至 今 任汇 2月22日至 今 任汇 3月22日至 9 任 2月22日至 9 年 2月22日至			证主要消费
ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金金、中证金量。的基金经理。2013年11月6日至今任任还要,2013年2月16日至今年任2月16日至今年任2月16日至今年在15年3月24日至今年11月21日至今年11月21日至今年11月21日至中间基金经理,2016年7月28日至今日中证上海上海上海上海上海上海上海上海上海上海上海上海上海上海上海上海上海上海上海			ETF 基金、中
证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金的基金经理,2013年1月添富沪深 300安中指数基金的基金经理,2015年2月16日至今任汇场产品或要基理,2015年2月16日至今任汇添富或要基金经理,2015年3月24日至李行在汇添富,2016年1月21日至今任汇添贴。2016年1月21日至今任汇汇为基金经理,2016年1月28日至一个任汇证为基金经理,2016年12月22日至三个任汇而基金经理,2016年12月22日至三个任汇证,1月21日至三个任汇证,1月21日至三个任汇证,1月22日至三个证证,1月22日至三个证证,1月22日至三个证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证			证医药卫生
金、中证金融地产 ETF 基金的基金经理,2013年11月6日至今任汇添富沪深数400 安的基金经理,2015年2月16日至今任任公司基金的基金经理,2015年3月24日至今任汇添富成长多因基金经理,2016年3月24日至今任汇添富省数基金的基金经理,2016年1月21日至今任汇添富省数基金的基位等7月28日至今任正证上海基金经理,2016年12月22日富中证互联网医疗指数(107)的基金经理,2017年8月10			ETF 基金、中
地产 ETF 基金的基金经理, 2013 年 11 月 6 日至今任汇添富户资深 3300 安中指数型理, 2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因基金经理, 2015 年 3 月 24 百至今任汇添富产业 要 2016 年 3 月 24 百至 安任汇添富市联 接基金的基金经理, 2016 年 1 月 21 日至今任汇添富市 4 基金经理, 2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理, 2016 年 12 月 22 日至今任汇派网医疗 指数 (10F) 的基金经理, 2017 年 8 月 10			证能源 ETF 基
的基金经理, 2013年11月6日至今任汇添富沪深300安中指数基金的基金经理, 2015年2月16日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理, 2015年3月24日至今任汇添加数基金的基金经理, 2016年7月28日至今任汇添加数基金经理, 2016年7月28日至今任中证上海国企。ETF的基金经理, 2016年12月22日至今任汇添网医疗,指数(LOF)的基金经理, 2017年8月10			
2013 年 11 月 6 日至今任汇添 富沪深 300 安 中指数基金的 基金经理, 2015 年 2 月 16 日至今任汇添 富成长多因的基 金经理,2015 年 3 月 24 日至 今任汇需主 要消费 61 年 2 日 21 官 转基金经 理,2016 年 1 月 21 日富中基 金的基金经 理,2016 年 7 月 28 日至今 任中证上海国 企 ETF 的基金 经理,2016 年 12 月 22 日至 今任汇涨》 医疗 行任汇》 医疗 发理,2016 年 12 月 22 日至 今任汇涨》 医疗 指数(LOF)的 基金经理, 2017 年 8 月 10			地产 ETF 基金
日至今任汇添富沪深 300 安中指数基金的基金经理,2015年2月16日至今任汇添富成长多因于股票基金的基金经理,2015年3月24日至今任汇费正订联接基金的基金经理,2016年1月21日至今任汇添富的基金经理,2016年7月28日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理,2016年12月22日至今任产证百联网医疗指数(LOF)的基金经理,2017年8月10			的基金经理,
富沪深 300 安中指数基金的基金经理,2015年2月16日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理,2015年3月24日至今任汽港正下联接金币基金经理,2016年1月21日至今任汇添高的基金经理,2016年7月28日至今任中证上海国金 ETF 的基金经理,2016年12月22日至今任产证宣联网医疗指数(LOF)的基金经理,2017年8月10			2013年11月6
中指数基金的基金经理,2015年2月16日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理,2015年3月24日至今任汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理,2016年1月21日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理,2016年7月28日至今任中证上海国企ETF的基金经理,2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数(LOF)的基金经理,2017年8月10			日至今任汇添
基金经理, 2015年2月16日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理, 2015年3月24日至今任汇添富主要消费。即基金经理, 2016年1月21日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理, 2016年7月28日至今任中证上海国金产时,也是第一个任理的基金经理,2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数(LOF)的基金经理, 2017年8月10			富沪深 300 安
2015年2月16 日至今任汇添 富成长多因子 股票基金的基 金经理,2015 年3月24日至 今任汇添富主 要消费 ETF 联 接基金的基金 经理,2016年 1月21日至今 任工添富中证 精准医指数基 金的基金经 理,2016年 7月28日至今 任中证上海国 企 ETF 的基金 经理,2016年 12月22日至 今任汇添富中 证互联网医疗 指数(LOF)的 基金经理, 2017年8月10			中指数基金的
日至今任汇添 富成长多因子 股票基金的基 金经理,2015 年3月24日至 今任汇添富主 要消费 ETF 联 接基金的基金 经理,2016年 1月21日至今 任产证上海国 企 ETF 的基金 经理,2016年 12月22日至 今任汇添富中 证互联网医疗 指数(LOF)的 基金经理, 2017年8月10			基金经理,
富成长多因子 股票基金的基 金经理,2015 年3月24日至 今任汇添富主 要消费 ETF 联 接基金的基金 经理,2016年 1月21日至今 任汇添富中证 精准医指数基 金的基金经 理,2016年7 月28日至今 任中证上海国 企 ETF 的基金 经理,2016年 12月22日至 今任汇添富中 证互联网医疗 指数(LOF)的 基金经理, 2017年8月10			2015年2月16
股票基金的基金经理,2015年3月24日至今任汇添富主要消费 ETF 联接基金的基金经理,2016年1月21日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理,2016年7月28日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理,2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数(LOF)的基金经理,2017年8月10			日至今任汇添
金经理, 2015年3月24日至今任汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理, 2016年1月21日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理, 2016年7月28日至今任中证上海国企ETF的基金经理, 2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数(LOF)的基金经理, 2017年8月10			富成长多因子
年 3 月 24 日至 今任汇添富主 要消费 ETF 联 接基金的基金 经理, 2016 年 1 月 21 日至今 任汇添富中证 精准医指数基金的基金经 理, 2016 年 7 月 28 日至今 任中证上海国企 ETF 的基金 经理, 2016 年 12 月 22 日至 今任汇添富中证互联网医疗指数 (LOF) 的基金经理, 2017 年 8 月 10			股票基金的基
今任汇添富主要消费 ETF 联接基金的基金经理,2016年1月21日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理,2016年7月28日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理,2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数(LOF)的基金经理,2017年8月10			金经理,2015
要消费 ETF 联接基金的基金经理,2016年1月21日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理,2016年7月28日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理,2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数(LOF)的基金经理,2017年8月10			年3月24日至
接基金的基金 经理,2016年 1月21日至今 任汇添富中证 精准医指数基 金的基金经 理,2016年7 月28日至今 任中证上海国 企ETF的基金 经理,2016年 12月22日至 今任汇添富中 证互联网医疗 指数(LOF)的 基金经理, 2017年8月10			今任汇添富主
经理,2016年 1月21日至今 任汇添富中证 精准医指数基 金的基金经 理,2016年7 月28日至今 任中证上海国 企ETF的基金 经理,2016年 12月22日至 今任汇添富中 证互联网医疗 指数(LOF)的 基金经理, 2017年8月10			要消费 ETF 联
1月21日至今 任汇添富中证 精准医指数基 金的基金经 理,2016年7 月28日至今 任中证上海国 企 ETF 的基金 经理,2016年 12月22日至 今任汇添富中 证互联网医疗 指数 (LOF) 的 基金经理, 2017年8月10			接基金的基金
任汇添富中证 精准医指数基 金的基金经 理,2016年7 月28日至今 任中证上海国 企 ETF 的基金 经理,2016年 12月22日至 今任汇添富中 证互联网医疗 指数(LOF)的 基金经理, 2017年8月10			经理,2016年
精准医指数基金的基金经理,2016年7月28日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理,2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数(LOF)的基金经理,2017年8月10			1月21日至今
金的基金经理,2016年7月28日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理,2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数(LOF)的基金经理,2017年8月10			任汇添富中证
理,2016年7月28日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理,2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数(LOF)的基金经理,2017年8月10			精准医指数基
月 28 日至今 任中证上海国 企 ETF 的基金 经理,2016 年 12 月 22 日至 今任汇添富中 证互联网医疗 指数 (LOF) 的 基金经理, 2017 年 8 月 10			金的基金经
任中证上海国 企 ETF 的基金 经理,2016年 12月22日至 今任汇添富中 证互联网医疗 指数(LOF)的 基金经理, 2017年8月10			理,2016年7
企 ETF 的基金 经理,2016年 12月22日至 今任汇添富中 证互联网医疗 指数(LOF)的 基金经理, 2017年8月10			月 28 日至今
经理,2016年 12月22日至 今任汇添富中 证互联网医疗 指数(LOF)的 基金经理, 2017年8月10			任中证上海国
12月22日至 今任汇添富中 证互联网医疗 指数(LOF)的 基金经理, 2017年8月10			企 ETF 的基金
今任汇添富中 证互联网医疗 指数 (LOF) 的 基金经理, 2017 年 8 月 10			经理,2016年
证互联网医疗 指数 (LOF) 的 基金经理, 2017 年 8 月 10			12月22日至
指数 (LOF) 的 基金经理, 2017 年 8 月 10			今任汇添富中
基金经理, 2017年8月10			证互联网医疗
2017年8月10			指数(LOF)的
			基金经理,
日至今任汇添			2017年8月10
			日至今任汇添

		富中证 500 指
		数(LOF)的基
		金经理,2018
		年3月23日至
		今任添富价值
		多因子股票的
		基金经理,
		2019年7月26
		日至今任添富
		中证长三角
		ETF 的基金经
		理,2019年9
		月 24 日至今
		任汇添富中证
		长三角 ETF 联
		接的基金经
		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,基金管理人对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, 第 6 页 共 13 页 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 7 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

三季度经济增速下行压力仍然较大,但9月的高频数据显示相对7-8月较差的经济数据可能有所改善。分项来看,受政策调控和融资收紧影响,三季度房地产投资增速持续进入下行区间;前期专项债集中发行叠加低基数的影响,基建投资稳中有升;在各项政策扶持下,制造业投资持续小幅反弹;消费在剔除汽车拖累后,总体保持平稳。贸易摩擦仍存在较大的不确定性,但市场对于贸易摩擦已经相对钝化,重点仍是政策落地和宏观数据能否提升经济阶段性企稳的预期。

货币政策方面,9月央行全面降准释放流动性宽松的信号。央行货币政策委员会三季度例会 公布:中国将保持稳健货币政策不变,注意松紧适度。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。

资本市场的重要性进一步提升。9月证监会在京召开全面深化资本市场改革工作座谈会,部署了深化资本市场改革的12个方面重点任务。会议明确资本市场改革发展工作成果和目标,强调鼓励资本市场发展以及金融科技建设。外管局宣布取消QFII和RQFII投资额度限制,海外增量资金有望持续进入A股。

三季度市场仍处于震荡调整状态,估值维持在合理区间。报告期末,沪深 300 指数的市盈率为 11.90,处于历史较低水平,未来存在进一步估值修复的空间。

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 安中指数基金份额净值为 1.5225 元,本报告期基金份额净值增长率为 2.69%; 同期业绩比较基准收益率为 1.57%。

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	307, 682, 536. 44	87. 29
	其中: 股票	307, 682, 536. 44	87. 29
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	19, 120, 969. 26	5. 42
8	其他资产	25, 695, 407. 77	7. 29
9	合计	352, 498, 913. 47	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, 811, 593. 50	0.86
В	采矿业	68, 569, 420. 99	21.05
С	制造业	144, 056, 564. 88	44. 21
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	21, 357, 534. 08	6. 56
Е	建筑业	5, 124, 865. 73	1.57
F	批发和零售业	3, 044, 600. 42	0.93
G	交通运输、仓储和邮 政业	5, 054, 338. 67	1. 55
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信 息技术服务业	29, 666, 608. 25	9. 11
J	金融业	18, 999, 500. 24	5 . 83
K	房地产业	2, 241, 353. 45	0.69
L	租赁和商务服务业	2, 977, 889. 88	0.91
M	科学研究和技术服 务业	317, 322. 00	0. 10
N	水利、环境和公共设 施管理业	198, 817. 30	0.06
0	居民服务、修理和其	-	_

	他服务业		
P	教育		_
Q	卫生和社会工作	1, 806, 715. 19	0.55
R	文化、体育和娱乐业	1, 108, 210. 04	0.34
S	综合		-
	合计	307, 335, 334. 62	94. 33

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	-	-
С	制造业	53, 036. 38	0.02
D	电力、热力、燃气及		
D	水生产和供应业	_	_
Е	建筑业	_	_
F	批发和零售业	_	_
G	交通运输、仓储和邮		
	政业	_	_
Н	住宿和餐饮业	_	_
I	信息传输、软件和信		
1	息技术服务业	294, 165. 44	0.09
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		
141	务业	_	_
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	_	_
R	文化、体育和娱乐业	_	_
S	综合	_	_
	合计	347, 201. 82	0.11

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	600028	中国石化	3, 088, 933	15, 506, 443. 66	4. 76
2	601088	中国神华	800, 211	15, 027, 962. 58	4.61
3	601857	中国石油	2, 112, 670	13, 077, 427. 30	4.01
4	600900	长江电力	503, 635	9, 181, 266. 05	2.82
5	601225	陕西煤业	1, 025, 366	8, 951, 445. 18	2. 75
6	600519	贵州茅台	6, 783	7, 800, 450. 00	2.39
7	002415	海康威视	241, 349	7, 795, 572. 70	2.39
8	000063	中兴通讯	216, 328	6, 924, 659. 28	2. 13
9	600276	恒瑞医药	78, 921	6, 367, 346. 28	1.95
10	000725	京东方A	1, 564, 538	5, 867, 017. 50	1.80

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	688168	安博通	2, 252	215, 966. 80	0.07
2	603927	中科软	884	78, 198. 64	0.02
3	300790	宇瞳光学	671	31, 094. 14	0.01
4	603786	科博达	816	21, 942. 24	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

注:报告期末本基金无股指期货持仓。

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

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,或在报告编制目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	34, 737. 97
2	应收证券清算款	25, 625, 055. 25
3	应收股利	_
4	应收利息	3, 493. 10
5	应收申购款	32, 121. 45
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	25, 695, 407. 77

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	公司名称	流通受限部分的公	占基金资产净	流通受限情况	
			允价值 (元)	值比例(%)	说明	
1	688168	安博通	215, 966. 80	0.07	新股流通受限	
2	603786	科博达	21, 942. 24	0.01	新股流通受限	

§6 开放式基金份额变动

报告期期初基金份额总额	218, 399, 191. 51
报告期期间基金总申购份额	9, 027, 579. 59
减:报告期期间基金总赎回份额	13, 425, 283. 56
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	214, 001, 487. 54

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

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

÷π	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
投资者类别	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	2019年7 月1日至 2019年9 月30日	152, 645, 529. 99	-	-	152, 645, 529. 99	71. 33
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、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时,更容易触发巨额赎回条款,基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、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。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、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 安中动态策略指数型证券投资基金募集的文件;
- 2、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富沪深 300 安中动态策略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 安中动态策略指数型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 2019年10月22日