

# 深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 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	汇添富深证 300ETF
场内简称	深 300ETF
基金主代码	159912
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 16 日
报告期末基金份额总额	63,948,991.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法。正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	深证 300 指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，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、以及标的指数所代表的股票市场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（2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	6,301,472.13
2. 本期利润	8,937,521.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1324
4. 期末基金资产净值	111,469,039.78
5. 期末基金份额净值	1.7431

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

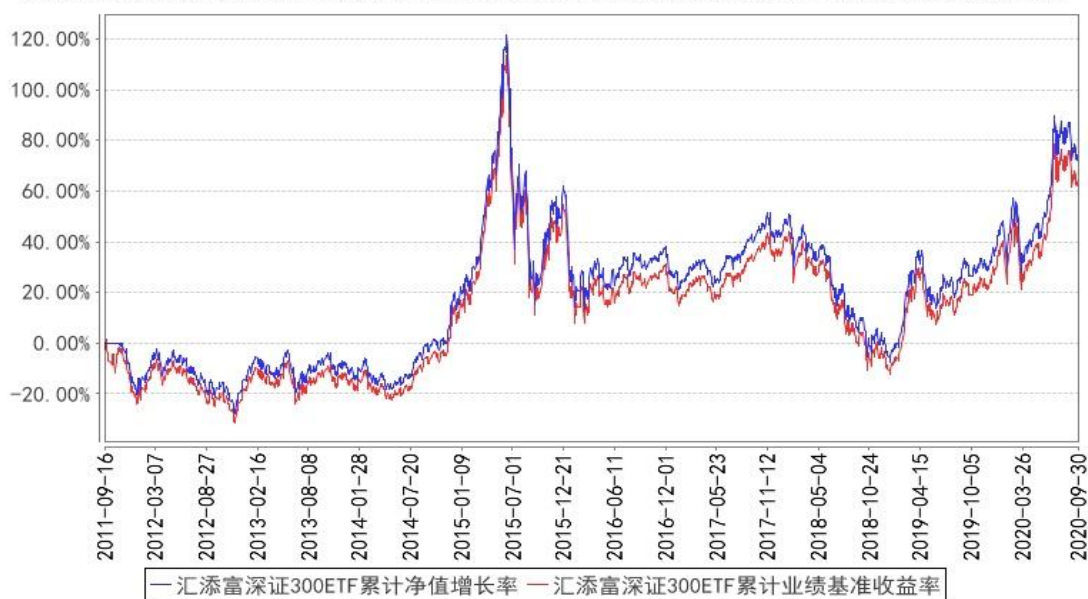
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 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	8.40%	1.75%	8.30%	1.76%	0.10%	-0.01%
过去六个月	31.55%	1.48%	30.90%	1.49%	0.65%	-0.01%
过去一年	37.91%	1.60%	37.92%	1.61%	-0.01%	-0.01%
过去三年	23.10%	1.53%	22.30%	1.54%	0.80%	-0.01%
过去五年	41.08%	1.51%	38.59%	1.53%	2.49%	-0.02%
自基金合同 生效日起至 今	74.31%	1.59%	64.03%	1.62%	10.28%	-0.03%

注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011 年 9 月 16 日）起 3 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

#### 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

汇添富深证300ETF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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011年9月16日）起3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	2015年8月18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。
赖中立	本基金的基金经理	2015 年 1 月 6 日	-	13 年	国籍：中国，学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012 年 11 月 1 日至今任汇添富黄金及贵金属基金（LOF）的基金经理，2014 年 3 月 6 日至今任汇添富恒生指数分级（QDII）基金的基金经理，2015 年 1 月 6 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，2015 年 5 月 26 日至 2016 年 7 月 13 日任汇添富香港优势混合基金的基金经理，2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证环境治理指数（LOF）基金的基金经理，2017 年 5 月 18 日至今任汇添富优选回报混合基金的基金经理，2017 年 11 月 24 日至今任汇添富中证港股通高股息投资指数（LOF）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。

深证 300 指数在电子、医药生物、计算机、家用电器等成长性板块配置比例接近 50%，今年三季度上涨 8.3%。本基金在报告期内遵循了 ETF 基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。本基金日常管理中非常重视风险管理，对股票和现金头寸严格管理、实时监控，基本实现了 ETF 平稳运作管理的目的。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.7431 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.40%，业绩比较基准收益率为 8.30%。

#### 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	110,443,268.45	98.88
	其中：股票	110,443,268.45	98.88
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	1,252,370.94	1.12
8	其他资产	1,013.35	0.00
9	合计	111,696,652.74	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	3,173,969.38	2.85
B	采矿业	343,331.35	0.31
C	制造业	73,505,610.64	65.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	375,727.51	0.34
E	建筑业	255,120.34	0.23
F	批发和零售业	833,910.60	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	2,073,309.18	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,903,100.70	7.09
J	金融业	10,037,376.91	9.00
K	房地产业	4,802,978.94	4.31
L	租赁和商务服务业	1,859,614.74	1.67
M	科学研究和技术服务业	951,291.00	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	341,672.90	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	296,933.00	0.27
Q	卫生和社会工作	2,195,836.76	1.97
R	文化、体育和娱乐业	1,310,560.50	1.18
S	综合	182,924.00	0.16
	合计	110,443,268.45	99.08

### 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资。

### 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	000858	五 粮 液	22,368	4,943,328.00	4.43
2	000333	美的集团	61,984	4,500,038.40	4.04
3	000651	格力电器	60,848	3,243,198.40	2.91
4	002475	立讯精密	53,388	3,050,056.44	2.74
5	000002	万 科 A	86,998	2,437,683.96	2.19
6	300750	宁德时代	10,100	2,112,920.00	1.90
7	300059	东方财富	83,648	2,006,715.52	1.80
8	300760	迈瑞医疗	5,100	1,774,800.00	1.59
9	002415	海康威视	44,211	1,684,881.21	1.51
10	000725	京东方 A	339,108	1,665,020.28	1.49

#### 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资。

### 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：报告期末本基金无国债期货持仓。

#### 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	901.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	111.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,013.35

##### 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

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的情况。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	65,548,991.00
报告期期间基金总申购份额	11,200,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	12,800,000.00
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	63,948,991.00

## §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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
中国工商银行股份有限公司—汇添富	1	2020 年 7 月 1 日至 2020 年 9 月 30 日	47,014,142.00	1,600,000.00	6,400,000.00	42,214,142.00	66.01

深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金						
产品特有风险						
<p>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。</p> <p>2、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。</p> <p>3、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。</p>						

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准深证 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《深证 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《深证 300 交易型开放式指数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、报告期内深证 300 交易型开放式指数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](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 10 月 28 日