

汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）2021 年第 1 季度报告

2021 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：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 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	汇添富中证全指证券公司指数（LOF）
基金主代码	501047
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 04 日
报告期末基金份额总额(份)	1,537,186,183.75
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。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，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，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收

	益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。	
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率*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	中信建投证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C
下属分级基金场内简称	全指证券	证券 C
下属分级基金的交易代码	501047	501048
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	593,493,670.55	943,692,513.20

注：汇添富中证全指证券公司指数 (LOF) A 的扩位证券简称为证券公司 LOF；汇添富中证全指证券公司指数 (LOF) C 的扩位证券简称为证券公司 LOFC。

§ 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(2021年01月01日 - 2021年03月31日)	
	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C
1. 本期已实现收益	6,432,000.55	8,507,484.36
2. 本期利润	-104,111,076.43	-161,272,188.18
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1828	-0.1838
4. 期末基金资产净值	641,011,483.86	1,022,287,137.37
5. 期末基金份额净值	1.0801	1.0833

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

汇添富中证全指证券公司指数（LOF）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	-14.59%	1.59%	-14.33%	1.60%	-0.26%	-0.01%
过去六个月	-13.65%	1.63%	-13.41%	1.64%	-0.24%	-0.01%
过去一年	13.54%	1.96%	11.07%	1.97%	2.47%	-0.01%
过去三年	21.31%	2.01%	13.52%	2.04%	7.79%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	8.01%	1.96%	-1.87%	2.00%	9.88%	-0.04%
汇添富中证全指证券公司指数（LOF）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④	①—③	②—④
过去三个月	-14.65%	1.59%	-14.33%	1.60%	-0.32%	-0.01%
过去六个月	-13.76%	1.63%	-13.41%	1.64%	-0.35%	-0.01%
过去一年	13.26%	1.96%	11.07%	1.97%	2.19%	-0.01%
过去三年	21.68%	2.01%	13.52%	2.04%	8.16%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	8.33%	1.96%	-1.87%	2.00%	10.20%	-0.04%

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

汇添富中证全指证券公司指数（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证全指证券公司指数（LOF）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（2017年12月04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 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
董瑾	本基金的 基金经理	2019年12月 31日		12	国籍:中国。学历:北京大学西方经济学硕士。从业资格: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12月31日任汇添富沪深300指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理助理。2017年12月18日至2019年12月31日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理助

					<p>理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2019 年 12 月 4 日至今任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 12 月 31 日至今任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2021 年 2 月 1 日至今任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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合规守信情况说明

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

本基金管理人通过建立嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人进一步完善了公司内部公平交易管理规范 and 流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略及投资品种。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统中的公平交易模块进行操作，实现事前和事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析，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溢价率进行了T分布检验。对于没有通过检验的交易，再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、根据交易价格、交易频率、交易数量等对不同组合之间的反向交易进行了综合分析。

通过上述管控措施的有效落实，本报告期内，本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易，也未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

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 9 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

今年 1-2 月，在国内外市场需求稳定恢复、同期基数较低以及“就地过年”等因素共同作用下，工业生产销售增长加快，企业收入、利润加速恢复，盈利水平回升明显。国家统计局数据显示，1-2 月份，全国规模以上工业企业实现利润 11140.1 亿元，同比增长 1.79 倍，比 2019 年 1-2 月份增长 72.1%，两年平均增长 31.2%，延续了去年下半年以来较快增长的良好态势。同时，若疫苗接种顺利、疫情控制得当，海外经济和需求也可能加速恢复，全球经济有望共振复苏。

政策方面，央行货币政策委员会 1 季度例会召开，对国内外经济形势表述较为乐观，同时政策方面仍以稳健中性为主，货币政策逐步回归常态化，流动性大概率仍将维持紧平衡。海外经济恢复和通胀预期下，引发市场对于流动性收紧的担忧，但目前海外政策仍维持宽松，后续进展尚需考虑疫情及经济恢复的具体情况。

资金面上，虽然 1 季度市场调整下，北向及南向资金波动略有加大，但总体仍保持相对稳定。中长期来看，外资当前对中国资产的配置比例仍然较低，随着金融的对外开放，外资或将逐步加大对于中国资产的配置。

一季度市场受到通胀预期等的影响出现了较大程度的调整，其中消费、医药、科技等板块调整幅度相对较大。同时，随着经济复苏的趋势进一步确立，顺周期的银行、基建、化工等板块有所表现。十四五规划中首次将“碳达峰、碳中和”写入五年规划，利好碳中和主题相关行业，碳中和或将成为今年较为明确的投资主线之一。今年在经济复苏和流动性边际收敛的趋势下，市场或将由估值驱动转换为盈利驱动，价值龙头的配置性价比有所提升。

券商板块维持资本市场深化改革的投资主线不变。资本市场进入了较长时间维度的政策支持周期，相关利好政策的逐步推进和落地，助力券商进一步高质量发展。随着政策红利的持续，券商业绩有望继续保持高速增长，支撑行业估值中枢上移。

报告期内，本基金遵循指数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。

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-14.59%;C 类基金份额净值增长率为

-14.65%。同期业绩比较基准收益率为-14.33%。

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	1,564,779,196.18	93.71
	其中：股票	1,564,779,196.18	93.71
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	95,043,004.18	5.69
8	其他资产	10,076,117.19	0.60
9	合计	1,669,898,317.55	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	1,563,961,706.49	94.03
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	1,563,961,706.49	94.03

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	657,597.89	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,036.12	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,674.06	0.00
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	114,647.42	0.01
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	13,534.20	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	817,489.69	0.05

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	600030	中信证券	9,121,612	217,915,310.68	13.10
2	300059	东方财富	7,298,850	198,966,651.00	11.96
3	601688	华泰证券	6,286,748	106,623,246.08	6.41
4	600837	海通证	8,322,034	92,124,916.38	5.54

		券			
5	601211	国泰君安	4,833,658	78,498,605.92	4.72
6	600999	招商证券	3,985,905	78,323,033.25	4.71
7	601377	兴业证券	5,647,833	47,724,188.85	2.87
8	000166	申万宏源	9,595,000	44,520,800.00	2.68
9	600958	东方证券	4,498,281	39,854,769.66	2.40
10	601901	方正证券	4,381,200	38,116,440.00	2.29

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	688135	利扬芯片	5,658	169,117.62	0.01
2	300957	贝泰妮	853	107,827.73	0.01
3	688665	四方光电	1,687	81,178.44	0.00
4	688316	青云科技	1,428	78,197.28	0.00
5	688630	芯碁微装	3,397	51,736.31	0.00

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投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

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、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、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	1,000,841.81
2	应收证券清算款	248,169.22
3	应收股利	-
4	应收利息	11,558.27
5	应收申购款	8,815,547.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,076,117.19

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	688135	利扬芯片	169,117.62	0.01	新股流通受限
2	300957	贝泰妮	107,827.73	0.01	新股流通受限
3	688665	四方光电	81,178.44	0.00	新股流通受限
4	688316	青云科技	78,197.28	0.00	新股流通受限
5	688630	芯碁微装	51,736.31	0.00	新股流通受限

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF) A	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF) C
本报告期期初基金份额总额	553,516,934.09	853,769,197.02
本报告期基金总申购份额	358,375,245.29	671,482,656.82
减:本报告期基金总赎回份额	318,398,508.83	581,559,340.64
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额	593,493,670.55	943,692,513.20

额总额		
-----	--	--

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

	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A	汇添富中证全指证券公司 指数 (LOF)C
报告期初持有的基金份额	10,001,350.04	-
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	10,001,350.04	-
报告期期末持有的本基 金份额占基金总份额比 例 (%)	1.69	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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末运用固有资金投资本基金。

§ 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	10,001,350.04	0.65	10,001,350.04	0.65	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	96,989.81	0.01	-	-	
合计	10,098,339.85	0.66	10,001,350.04	0.65	

§ 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者超过 20%的情况

注：无。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

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中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富中证全指证券公司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、报告期内汇添富中证全指证券公司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 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

2021 年 04 月 22 日