

汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 06 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 07 月 21 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 19 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 04 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 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 指数增强
基金主代码	005530
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 11 月 03 日
报告期末基金份额总额(份)	267,247,488.72
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，结合增强型的主动投资，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，谋求基金资产的长期增值。
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，结合深入的宏观面、基本面研究及量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，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%，力求实现超越标的指数的业绩表现和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金的投

	资策略主要包括：资产配置策略、股票投资策略、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，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	005530	010556
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	254,003,428.81	13,244,059.91

§ 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 04 月 01 日 - 2021 年 06 月 30 日)	
	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C
1. 本期已实现收益	7,544,285.52	178,637.16
2. 本期利润	19,287,913.13	478,047.04
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0807	0.0930
4. 期末基金资产净值	462,103,086.39	24,038,935.92
5. 期末基金份额净值	1.8193	1.8151

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

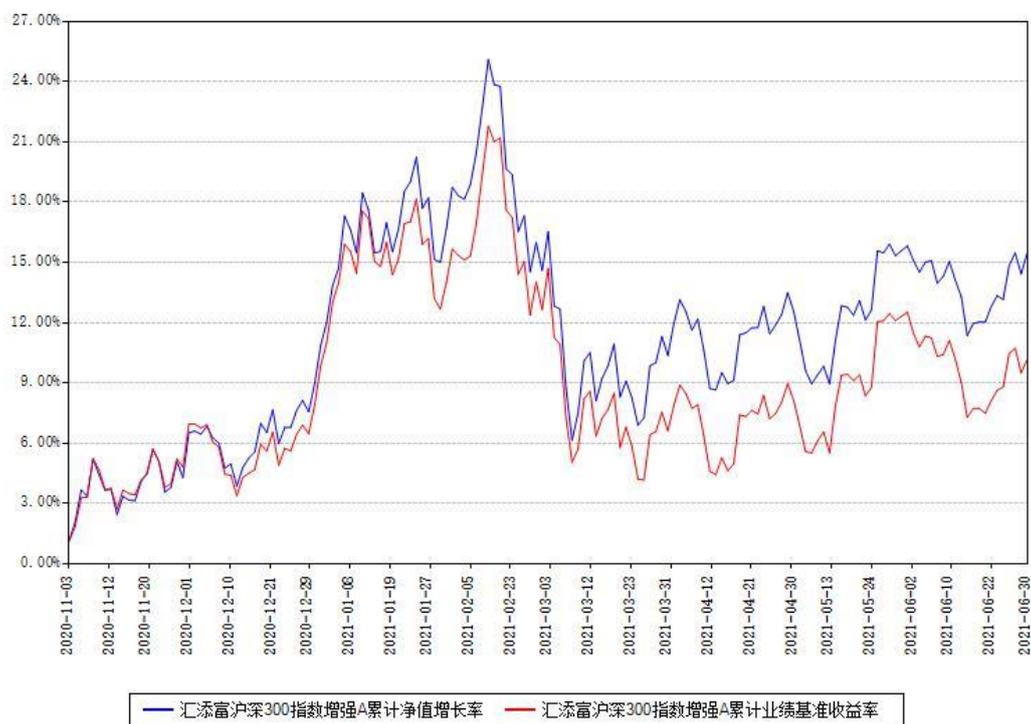
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富沪深 300 指数增强 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	4.64%	0.92%	3.32%	0.93%	1.32%	-0.01%
过去六个月	4.16%	1.29%	0.29%	1.25%	3.87%	0.04%
自基金合同生效日起至今	15.48%	1.20%	10.18%	1.17%	5.30%	0.03%
汇添富沪深 300 指数增强 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	4.54%	0.92%	3.32%	0.93%	1.22%	-0.01%
过去六个月	3.96%	1.29%	0.29%	1.25%	3.67%	0.04%
自基金合同生效日起至今	13.90%	1.21%	8.93%	1.17%	4.97%	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

汇添富沪深300指数增强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指数增强C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本《基金合同》生效之日为2020年11月03日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起6个月，截止本报告期末，本基金已完成建

仓，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		
吴振翔	本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监	2018 年 03 月 23 日		15	<p>国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。从业资格:证券投资基金从业资格。</p> <p>从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。</p> <p>2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2011 年 9 月 28</p>

				<p>日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 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>2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基</p>
--	--	--	--	---

				<p>金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金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疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券</p>
--	--	--	--	---

					<p>投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 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>
许一尊	本基金的基金经理	2018 年 03 月 23 日		11	<p>国籍:中国。学历:上海财经大学经济学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2010 年 7 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高级分析师。2015 年 11 月 24 日至今任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增</p>

					强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 5 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

回顾二季度，国内经济上行，通胀预期有所回落，大宗商品价格上涨预期转向，流动性整体相对宽松，市场迎来反弹。投资者风险偏好有所提升，小市值、高 Beta、成长等风格表现较好。核心资产内部出现分化，更关注短期成长和景气度，二三线龙头表现较好。中小市值股票成交活跃，偏短线的交易类策略同样表现较好。稳健类风格相对承压，一些质量类指标以及偏逆向的市场面指标表现一般。

行业方面分化明显，新能源车、光伏、芯片等新兴成长行业维持高景气，叠加未来较大的想象空间，继续上涨；受大宗商品价格持续上行的影响，钢铁、煤炭、化工等周期行业盈利出色，也有较大涨幅。与此同时，消费以及部分制造行业整体表现较为一般。

报告期内，本基金遵循量化指数增强基金投资原则，相对业绩比较基准保持了相对均衡的行业配置和风格配置，组合跟踪误差得到了有效的控制，获得了一定的超额收益。

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 4.64%；C 类基金份额净值增长率为 4.54%。同期业绩比较基准收益率为 3.32%。

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	455,871,106.69	93.28

	其中：股票	455,871,106.69	93.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,091,200.00	0.22
	其中：债券	1,091,200.00	0.22
	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	31,014,686.46	6.35
8	其他资产	709,940.08	0.15
9	合计	488,686,933.23	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	1,123,588.68	0.23
B	采矿业	8,972,870.00	1.85
C	制造业	217,189,570.71	44.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,875,152.00	0.59
E	建筑业	3,151,305.00	0.65
F	批发和零售业	4,670,560.30	0.96
G	交通运输、仓储和邮政业	2,439,206.00	0.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,205,920.00	1.07
J	金融业	94,062,713.35	19.35
K	房地产业	922,347.00	0.19

L	租赁和商务服务业	14,148,424.00	2.91
M	科学研究和技术服务业	8,348,126.08	1.72
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	9,109,671.18	1.87
R	文化、体育和娱乐业	3,114,440.00	0.64
S	综合	-	-
	合计	375,333,894.30	77.21

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	71,732,196.69	14.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,361,100.39	0.28
E	建筑业	28,336.72	0.01
F	批发和零售业	86,476.34	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	4,112,275.00	0.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,243,207.83	0.26
J	金融业	131,961.10	0.03
K	房地产业	261,136.00	0.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	27,800.29	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,541,431.75	0.32
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	80,537,212.39	16.57

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	7,802	16,046,373.40	3.30
2	000858	五粮液	41,500	12,362,435.00	2.54
3	601888	中国中免	35,500	10,653,550.00	2.19
4	600036	招商银行	162,600	8,811,294.00	1.81
5	601318	中国平安	134,400	8,639,232.00	1.78
6	603259	药明康德	53,312	8,348,126.08	1.72
7	002142	宁波银行	203,700	7,938,189.00	1.63
8	600919	江苏银	1,003,390	7,124,069.00	1.47

		行			
9	603501	韦尔股份	21,600	6,955,200.00	1.43
10	600809	山西汾酒	15,500	6,944,000.00	1.43

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	300685	艾德生物	50,000	5,204,000.00	1.07
2	002920	德赛西威	45,600	5,019,648.00	1.03
3	603337	杰克股份	176,800	4,725,864.00	0.97
4	300782	卓胜微	8,120	4,364,500.00	0.90
5	600563	法拉电子	26,300	4,164,868.00	0.86

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	595,000.00	0.12
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）	496,200.00	0.10
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	1,091,200.00	0.22

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	019640	20 国债 10	5,950	595,000.00	0.12
2	113050	南银转 债	3,580	358,000.00	0.07
3	127038	国微转 债	700	70,000.00	0.01
4	123117	健帆转 债	682	68,200.00	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

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

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、招商银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、江苏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	83,046.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,821.84
5	应收申购款	611,071.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	709,940.08

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

注：本基金本报告期末积极投资前十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 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C
本报告期初基金份	225,729,117.61	4,642,542.58

额总额		
本报告期基金总申购份额	38,420,504.00	12,464,024.37
减：本报告期基金总赎回份额	10,146,192.80	3,862,507.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	254,003,428.81	13,244,059.91

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：本基金的基金管理人本报告期末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价值多因子量化多策略股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 指数增强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 指数增强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

2021 年 07 月 21 日