汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）2022 年第 1 季度报告

2022 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：2022 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 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 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)	1,876,493,655.14
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，从而使得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)	829,137,888.26	1,047,355,766.88

注：A 类份额扩位证券简称：证券公司 LOF；C 类份额扩位证券简称：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(2022 年 01 月 01 日 - 2022 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	-13,203,931.28	-16,803,763.34
2.本期利润	-204,921,028.85	-208,938,278.84
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2252	-0.2116
4.期末基金资产净值	822,177,297.69	1,039,065,385.46
5.期末基金份额净值	0.9916	0.9921

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。

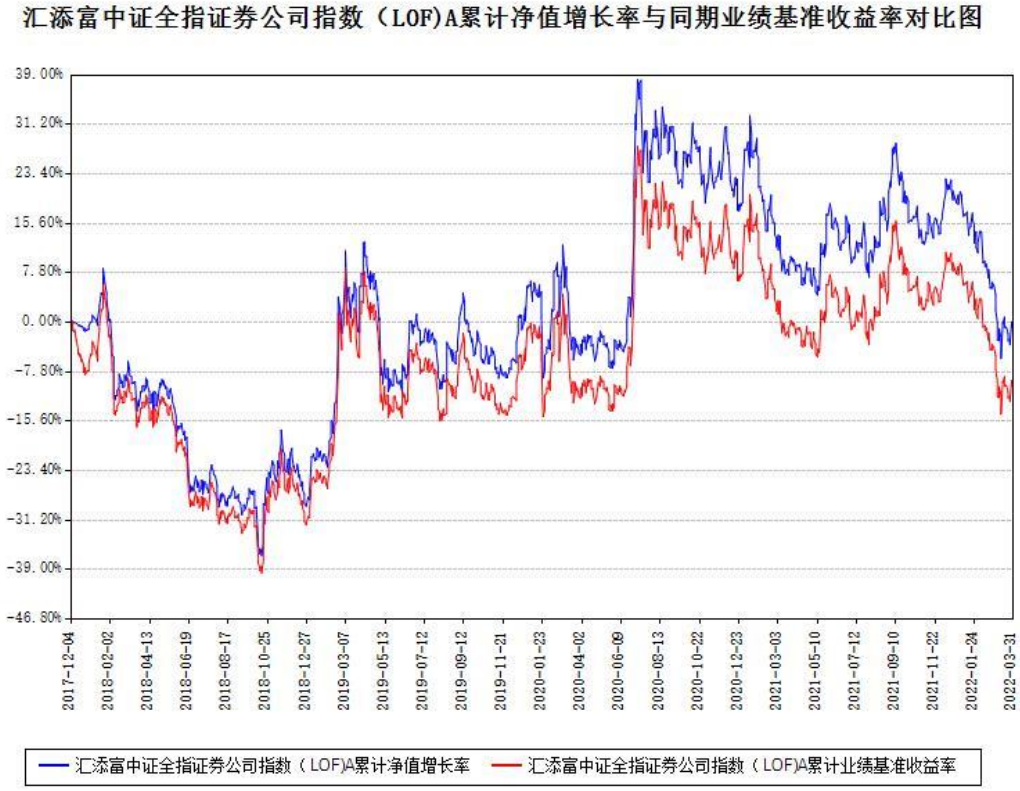
3.2 基金净值表现

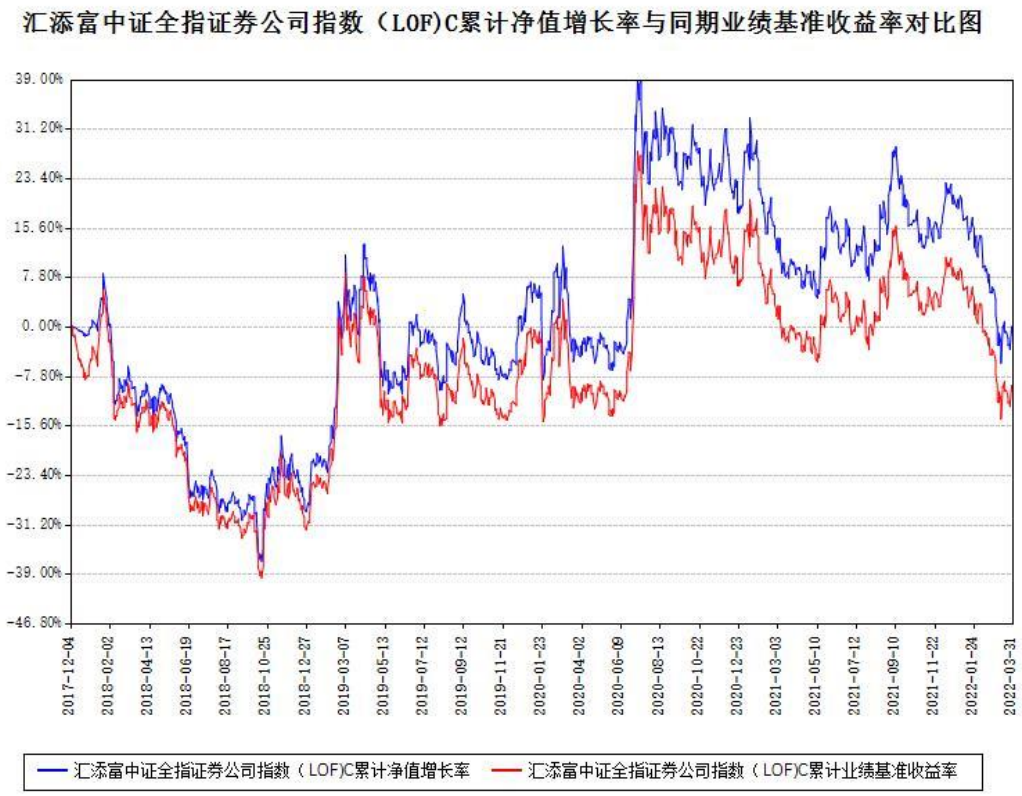
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-17.78%	1.65%	-17.70%	1.65%	-0.08%	0.00%
过去六个月	-16.50%	1.38%	-16.31%	1.38%	-0.19%	0.00%
过去一年	-8.19%	1.51%	-8.31%	1.52%	0.12%	-0.01%
过去三年	-6.14%	1.82%	-11.30%	1.84%	5.16%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	-0.84%	1.87%	-10.03%	1.90%	9.19%	-0.03%
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	-17.84%	1.65%	-17.70%	1.65%	-0.14%	0.00%
过去六个月	-16.60%	1.38%	-16.31%	1.38%	-0.29%	0.00%
过去一年	-8.42%	1.51%	-8.31%	1.52%	-0.11%	-0.01%
过去三年	-6.42%	1.82%	-11.30%	1.84%	4.88%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	-0.79%	1.87%	-10.03%	1.90%	9.24%	-0.03%

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





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		13	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。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。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。2021 年 8 月 9 日至今任汇添富中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 11 日至今任汇添富中证电池主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 26 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联接基金的基金经理。2022 年 3 月 3 日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数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遵规守信情况说明

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事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统中的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析，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平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人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成交量的 5%的情况有 7 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，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

今年以来，内外部环境局势相对复杂多变。外部环境主要缘于美联储加息对全球流动性带来一定的负面冲击；地缘政治冲突带来大宗商品的涨价和供应链的成本端压力。国内也出现了局部的疫情反复，稳增长压力相对较大。统计局数据显示今年 1-2 月份经济延续恢复态势。从结构上来看，基建和制造业继续发力，地产投资处于低位，消费受疫情影响恢复较慢。3 月份，制造业 PMI 指数和非制造业商务活动指数分别为 49.5%和 48.4%，较上月降低 0.7 和 3.2 个百分点，表明我国经济总体景气水平有所回落。后续随着局部地区疫情得到有效控制，预计受抑制的产需将会逐步恢复，市场有望回暖。

政策方面，稳增长仍处于重要位置。3 月 16 日，国务院金融稳定发展委员会召开专题会议，研究当前经济形势和资本市场问题。会议提出要切实振作经济，货币政策要主动应对，新增贷款要保持适度增长。货币政策后续大概率仍将延续宽松。

一季度，不确定性导致全球资本市场避险情绪升温，波动加大。A 股市场也出现了较大幅度的调整。行业方面，传统能源和稳增长的建材、金融板块表现相对稳定。新能源板块由于前期估值较高，一季度仍然延续调整。医药板块前期调整比较到位，政策边际缓和，业绩有所恢复，同时检验检测和生物医药等板块受益于疫情需求增量，有望迎来估值修复的行情。

券商板块维持资本市场深化改革和券商财富管理转型的投资主线不变。资本市场进入了较长时间维度的政策支持周期，相关利好政策逐步推进和落地，助力券商进一步高质量发展。同时随着财富管理转型的发展，券商业绩增速有望提高、业绩波动有望降低，支撑行业估值中枢上移。

现阶段来说，券商板块业绩高增和当前的估值水平出现了一定程度的错配，全面注册制推进等资本市场深化改革措施的逐步落地，以及流动性进一步宽松的可能都为券商板块提供了边际改善的空间。

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-17.78%;C 类基金份额净值增长率为-17.84%。同期业绩比较基准收益率为-17.70%。

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	1,754,480,595.56	93.84
	其中：股票	1,754,480,595.56	93.84
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	110,431,739.24	5.91
8	其他资产	4,732,868.58	0.25
9	合计	1,869,645,203.38	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 76,157,101.00 元，占期末基金资产净值比例 4.09%。

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	1,751,758,183.23	94.12
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	1,751,758,183.23	94.12

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	149.10	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,634,161.60	0.14
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	30,289.96	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	10,001.02	0.00
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	31,984.45	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	74.10	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	15,752.10	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,722,412.33	0.15

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	11,623,994	242,941,474.60	13.05

2	300059	东方财富	9,585,440	242,895,049.60	13.05
3	601688	华泰证券	6,110,748	90,927,930.24	4.89
4	601211	国泰君安	5,351,158	84,066,692.18	4.52
5	600837	海通证券	7,775,234	80,084,910.20	4.30
6	600999	招商证券	4,403,031	63,711,858.57	3.42
7	000776	广发证券	3,511,602	61,733,963.16	3.32
8	000166	申万宏源	13,367,700	58,550,526.00	3.15
9	600958	东方证券	4,956,181	54,418,867.38	2.92
10	601377	兴业证券	6,355,833	48,812,797.44	2.62

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	688048	长光华芯	6,790	548,632.00	0.03
2	688110	东芯股份	14,044	469,210.04	0.03
3	688295	中复神	13,998	410,561.34	0.02

		鹰			
4	688337	普源精电	6,563	399,555.44	0.02
5	688162	巨一科技	5,671	276,971.64	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

注:本基金本报告期未投资国债期货。

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，海通证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、兴业证券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	884,969.36
2	应收证券清算款	704,425.92
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,115,074.88
6	其他应收款	28,398.42
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,732,868.58

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

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	300059	东方财富	101,360.00	0.01	转融通出借流通受限

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	688048	长光华芯	548,632.00	0.03	新股流通受限
2	688110	东芯股份	469,210.04	0.03	新股流通

					受限
3	688295	中复神鹰	410,561.34	0.02	新股流通受限
4	688337	普源精电	399,555.44	0.02	新股流通受限
5	688162	巨一科技	276,971.64	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	851,779,328.55	956,070,411.87
本报告期基金总申购份额	190,115,108.97	340,975,926.09
减：本报告期基金总赎回份额	212,756,549.26	249,690,571.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	829,137,888.26	1,047,355,766.88

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

注：本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

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未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

注：本基金成立后有 10,001,350.04 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 12 月 04 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

§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）在规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

上海市黄浦区外马路 728 号　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

2022 年 04 月 22 日