

汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）

更新招募说明书摘要

（2020 年 4 月 14 日更新）

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国国际金融股份有限公司

重要提示

汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）（A 类基金份额：证券简称：沪深 300A，扩位证券简称：沪深 300LOF，基金代码：501043；C 类基金份额：证券简称：沪深 300C，扩位证券简称：沪深 300LOFC，基金代码：501045；以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2017 年 7 月 21 日证监许可【2017】1332 号文注册募集。本基金基金合同于 2017 年 9 月 6 日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的价值和收益作出实质性判断或者保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资者拟认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金产品资料概要、基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，全面认识本基金产品的风险收益特征，并承担基金投资中出现的各类风

险，包括但不限于：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的指数投资风险、上市交易风险、股指期货、股票期权等金融衍生品投资风险、参与融资及转融通业务特定风险等。

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型、债券型和货币市场基金，属于较高预期风险、较高预期收益的基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金投资中小企业私募债券，本基金投资中小企业私募债券属于高风险的债券投资品种，其流动性风险和信用风险均高于一般债券品种，会影响组合的风险特征。中小企业私募债券的流动性风险在于该类债券采取非公开方式发行和交易，由于不公开资料，外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级，可能会降低市场对该类债券的认可度，从而影响该类债券的市场流动性。中小企业私募债券的信用风险在于该类债券发行主体的资产规模较小、经营的波动性较大，同时，各类材料（包括募集说明书、审计报告）不公开发布，也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度。

本基金更新招募说明书“基金的投资”章节中有关“风险收益特征”的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行“销售适当性风险评价”，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的基金产品“风险等级评价”与“基金的投资”章节中“风险收益特征”的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金单一投资者（基金管理人作为发起资金提供方的除外）持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回、基金份额上市交易、基金管理人委托的登记机构技术条件不允许等基金管理人无法予以控制的情形导致被动达到或超过 50% 的除外。

本基金本次更新的招募说明书主要根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和修订后的基金合同对相关信息进行更新，同时对基金管理人、基金托管人、财务数据和净值表现等其他信息一并更新，更新所载内容截止日为 2020 年 4 月 14 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 12 月 31 日。

一、基金管理人

一、基金管理人简况

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼

法定代表人：李文

成立时间：2005 年 2 月 3 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[2005]5 号

注册资本：人民币 132,724,224 元

联系人：李鹏

联系电话：(021) 28932888

股东名称及其出资比例：

股东名称	股权比例
东方证券股份有限公司	35.412%
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	24.656%
上海上报资产管理有限公司	19.966%
东航金控有限责任公司	19.966%
合计	100%

二、主要人员情况

1、董事会成员

李文先生，2015 年 4 月 16 日担任董事长。国籍：中国，厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长，汇添富资产管理(香港)有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处科长，中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局杏林支局副行长、副局长，中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处长，东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理，稽核总部总经理，东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理，汇添富基金管理股份有限公司督察长。

程峰先生，2016 年 11 月 20 日担任董事。国籍：中国，上海交通大学工商管理硕士。现任上海报业集团副总经理，上海上报资产管理有限公司董事长，上海文化产权交易所股份有限公司董事长，上海瑞力投资基金管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会团委副书记、书记，上海机械进出口(集团)有限公司副总裁，上海市对外经济贸易委员会技术进口处副处长，上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长、处长，上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任，上海国际集团有限公司行政管理总部总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长，上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。

林福杰先生，2018 年 3 月 21 日担任董事。国籍：中国，上海交通大学工商管理硕士。现任东航金控有限责任公司总经理、党委副书记、东航集团财务有限责任公司董事长。曾任东航期货有限责任公司部门经理，东航集团财务有限责任公司副总经理，国泰人寿保险有限责任公司副总经理，东航金控有限责任公司党委书记、副总经理。

张晖先生，2015 年 4 月 16 日担任董事，总经理。国籍：中国，上海财经大学经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理，汇添富资本管理有限公司董事长。历任申银万国证券研究所高级分析师，富国基金管理有限公司研究主管和基金经理，汇添富基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监，曾担任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

林志军先生，2015 年 4 月 16 日担任独立董事。国籍：中国香港，厦门大学经济学博士，加拿大 Saskatchewan 大学工商管理理学硕士。现任澳门科技大学副校长兼商学院院长、教授、博导。历任福建省科学技术委员会计划财务处会计，

五大国际会计师事务所 Touche Ross International(现为德勤) 加拿大多伦多分所审计员, 厦门大学会计师事务所副主任会计师, 厦门大学经济学院讲师、副教授, 伊利诺大学(University of Illinois)国际会计教育与研究中心访问学者, 美国斯坦福大学(Stanford University)经济系访问学者, 加拿大 Lethbridge 大学管理学院会计学讲师、副教授 (tenured), 香港大学商学院访问教授, 香港浸会大学商学院会计与法律系教授, 博导, 系主任。

杨燕青女士, 2011 年 12 月 19 日担任独立董事, 国籍: 中国, 复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑, 第一财经研究院院长, 国家金融与发展实验室特邀高级研究员, 上海政协委员, 《第一财经日报》创始编委之一, 第一财经频道高端对话节目《经济学人》等栏目创始人和主持人, 《波士堂》等栏目资深评论员。2002-2003 年期间受邀成为约翰-霍普金斯大学访问学者。

魏尚进 (Shangjin Wei) 先生, 2020 年 1 月 9 日担任独立董事, 国籍: 美国, 加州大学伯克利分校博士。现任复旦大学泛海国际金融学院访问教授、哥伦比亚大学终身讲席教授。曾任哈佛大学肯尼迪政府学院助理教授、副教授, 世界银行顾问, 国际货币基金组织工作贸易与投资处处长、研究局助理局长。

2、监事会成员

任瑞良先生, 2004 年 10 月 20 日担任监事, 2015 年 6 月 30 日担任监事会主席。国籍: 中国, 大学学历, 会计师、非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上报资产管理有限公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管, 文汇新民联合报业集团文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理等。

王如富先生, 2015 年 9 月 8 日担任监事。国籍: 中国, 硕士研究生, 注册会计师。现任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任。历任申银万国证券计划统筹总部综合计划部专员、发展协调办公室专员, 金信证券规划发展总部总经理助理、秘书处副主任 (主持工作), 东方证券研究所证券市场战略资深研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

毛海东先生, 2015 年 6 月 30 日担任监事, 国籍: 中国, 国际金融学硕士。现任东航金控有限责任公司总经理助理兼财富管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责任公司, 东航集团财务有限责任公司。

王静女士，2008 年 2 月 23 日担任职工监事，国籍：中国，中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部，东航金控有限责任公司研究发展部。

林旋女士，2008 年 2 月 23 日担任职工监事，国籍：中国，华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监，汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生，2013 年 8 月 8 日担任职工监事，国籍：中国，北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司，泰科电子（上海）有限公司能源事业部。

3、高管人员

李文先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

张晖先生，2015 年 6 月 25 日担任总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

雷继明先生，2012 年 3 月 7 日担任副总经理。国籍：中国，工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理，中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011 年 12 月加盟汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

娄焱女士，2013 年 1 月 7 日担任副总经理。国籍：中国，金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处工作，负责投资银行、证券投资研究，以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011 年 4 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

袁建军先生，2015 年 8 月 5 日担任副总经理。国籍：中国，金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理，汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理，并于 2014 年至 2015 年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005 年 4 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。

李骁先生，2017 年 3 月 3 日担任副总经理。国籍：中国，武汉大学金融学硕士。历任厦门建行计算机处副处长，厦门建行信用卡部副处长、处长，厦门建

行信息技术部处长,建总行北京开发中心负责人,建总行信息技术管理部副总经理,建总行信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任,建总行信息技术管理部资深专员(副总经理级)。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席技术官。

李鹏先生,2015年6月25日担任督察长。国籍:中国,上海财经大学经济学博士,历任上海证监局主任科员、副处长,上海农商银行同业金融部副总经理,汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

4、基金经理

(1) 现任基金经理

董瑾女士,国籍:中国,北京大学西方经济学硕士,11年证券从业经验。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8月27日任上证上海改革发展主题ETF的基金经理助理,2017年12月18日至2019年12月31日任上海国企ETF联接、汇添富沪深300指数(LOF)、汇添富中证全指证券公司指数(LOF)的基金经理助理,2019年12月4日至今任添富沪深300ETF的基金经理,2019年12月31日至今任上海国企ETF联接、汇添富沪深300指数(LOF)、汇添富中证全指证券公司指数(LOF)的基金经理,2020年3月5日任添富中证国企一带一路ETF联接基金的基金经理。

(2) 历任基金经理

楚天舒女士,2017年9月6日至2019年12月31日任汇添富沪深300指数(LOF)的基金经理。

5、投资决策委员会

主席:袁建军(副总经理)

成员:韩贤旺(首席经济学家)、王栩(总经理助理,权益投资总监)、陆文磊(总经理助理,固定收益投资总监)、劳杰男(研究总监)

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：中国国际金融股份有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：沈如军

成立时间：1995 年 7 月 31 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 4,368,667,868 元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可[2015]1441 号

联系人：张萱

联系电话：010-65051166

中国国际金融股份有限公司（中金公司，3908.HK）是由国内外著名金融机构和公司基于战略合作关系共同投资组建的中国第一家中外合资投资银行。

自 1995 年成立以来，中金公司一直致力于为客户提供高质量金融增值服务，建立了以研究为基础，投资银行、股票业务、固定收益、财富管理和投资管理全方位发展的业务结构。凭借深厚的经济、行业、法律法规等专业知识和优质的客户服务，中金公司在海内外媒体评选中屡获“中国最佳投资银行”“最佳销售服务团队”“最具影响力研究机构”等殊荣。

中金公司总部设在北京，在境内设有多家子公司，在上海和深圳设有分公司，在北京、上海、深圳等 18 个城市设有证券营业部。公司亦积极开拓海外市场，在香港、纽约、伦敦、新加坡四个国际金融中心设立子公司，不断拓展业务的辐射广度和深度，以把握资本跨境流动和财富全球配置的发展浪潮，令公司始终站在国际化发展的前沿。

2015 年，中金公司在香港联交所主板成功挂牌上市，发行规模 8.11 亿美元，股票代码 3908.HK。秉承“植根中国，融通世界”的理念，通过境内外业务的无缝对接，中金公司将持续为客户提供一流的金融服务，协助客户实现其战略发展目标。

中金公司已取得多项业务牌照并开展业务，中金公司拥有证券市场业务全牌

照。业务领域跨越境内境外市场，覆盖证券、证券投资基金、直接股权投资等多个领域，包括但不限于经纪业务、自营业务、基金的发起和管理、金融产品代销、托管业务、承销业务、投融资顾问、融资融券业务、场外衍生品等。

中金公司连续 9 年被评为 A 类 AA 级券商。最近 3 个会计年度的年末净资产均不低于 20 亿元人民币。最近三个年度内各项风险控制指标持续符合监管标准。

中金公司资产托管部（下文简称“托管部”）于 2014 年 5 月正式成立，负责资管产品托管及运营外包业务，为公募、私募基金等机构客户提供资产托管、运营外包等服务。

中金公司资产托管部为独立部门，与资管、自营、经纪、投行相互隔离，人员及岗位设置实现管理条线独立，有独立的办公场所和独立的网络系统、机房、应用系统、多项备份措施，从而保证利益隔离和信息隔离，保证了托管业务的独立。

资产托管部人员均具备金融、会计等相关专业学历背景，全部取得了基金从业资格、证券从业资格。清算、估值、注册登记、投资监督等主要业务岗位人员来自托管银行、基金管理公司、信托公司，平均从业年限 5 年以上，具备丰富的资管产品、基金运作管理经验。

三、相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、场外销售机构

（1）直销机构

1) 汇添富基金管理股份有限公司直销中心

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市浦东新区樱花路 868 号建工大唐国际广场 A 座 7 楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932893

传真：（021）50199035 或（021）50199036

联系人：陈卓膺

客户服务电话：400-888-9918（免长途话费）

网址：www.99fund.com

邮箱：guitai@htffund.com

2) 汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统 (trade.99fund.com)

(2) 其他场外销售机构

本基金的其他场外销售机构请详见基金管理人官网公示的销售机构信息表。基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并在基金管理人网站公示。

2、场内销售机构

本基金办理场内认购、申购、赎回、交易业务的销售机构为具有基金销售业务资格、经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位。具体会员单位名单可在上海证券交易所网站查询。

二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：010-58598839

传真：010-58598907

联系人：朱立元

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
邮政编码：100738
执行事务合伙人：毛鞍宁
电话：010-58153000
传真：010-85188298
业务联系人：徐艳
经办会计师：徐艳、许培菁

四、基金的名称

本基金名称：汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）
基金简称：汇添富沪深300指数（LOF）
A类基金份额：证券简称：沪深300A，扩位证券简称：沪深300LOF，基金代码：501043
C类基金份额：证券简称：沪深300C，扩位证券简称：沪深300LOFC，基金代码：501045

五、基金的类型

本基金为股票型发起式证券投资基金。

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，

基金还可投资于其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（分离交易可转债）、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款）、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，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，以更好地实现本基金的投资目标。

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%。

1、股票投资策略

本基金主要采用完全复制法来构建股票投资组合，并根据标的指数成份股组成及其权重的变动对其进行适时调整，以拟合、跟踪标的指数的收益表现。同时，

本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票发生增发或配股、成份股停牌或因法律法规原因被限制投资、市场流动性不足等情况,对股票投资组合进行实时调整,以保证基金净值增长率与标的指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

1) 定期调整:根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

2) 不定期调整

A. 当标的指数成份股发生增发、配股等股权变动而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

B. 根据基金申购赎回情况,调整股票投资组合,以有效跟踪标的指数;

C. 根据法律、法规规定,成份股在标的指数中的权重因其他原因发生相应变化的,本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。

2、固定收益类资产投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,参与固定收益类资产投资,其投资目的是保证基金资产流动性,有效利用基金资产,降低跟踪误差。

(1) 可转债投资策略

本基金投资可转债将主要采用可转债相对价值分析策略。可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值,把握可转债的价值走向,选择相应券种。其次,在进行可转债筛选时,本基金还对可转债自身的基本面要素(包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等)进行综合分析,形成对基础股票的价值评估。本基金将可转债自身的基本面分析和其基础股票的基本面分析结合在一起,最终确定投资的品种。

(2) 中小企业私募债券投资策略

本基金将在严格控制信用风险的基础上,通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券,并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险。本基金对中小企业私募债券的投资策略以持有到期为主,在综合考虑债券信用资质、债券收益率和期限的前提下,重点选择资质较好、收益率较好的中小企业私募债券进行投资。

(3) 资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上,对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析,评估

其相对投资价值并作出相应的投资决策,以在控制风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。在资产支持证券的选择上,本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的策略。

3、金融衍生工具投资策略

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、权证、国债期货、股票期权等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以控制并降低投资组合风险、提高投资效率,降低跟踪误差,从而更好地实现本基金的投资目标。

(1) 股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等,以降低交易成本和组合风险,提高投资效率。

(2) 权证投资策略

本基金将通过对权证标的证券的基本面进行研究,结合多种定价模型和投资策略,根据基金资产组合情况适度进行权证的投资。

(3) 国债期货投资策略

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析,对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控,在追求基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的中长期稳定增值。

(4) 股票期权投资策略

本基金投资股票期权将按照风险管理的原则,结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求,确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。若相关法律法规发生变化时,基金管理人股票期权投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种,本基金将在履行适当程序后,纳入投资范围并制定相应投资策略。

4、融资及转融通投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上,审慎参与融资及转融通交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析,确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务法律法规发生变化,本基金将从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

未来,随着投资工具的发展和丰富,本基金可在不改变投资目标和风险收益

特征的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明更新中公告。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(5) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(8) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(11) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

(13) 本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(14) 本基金参与股指期货和国债期货交易的，应当遵守下列要求：

1) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10%; 持有的买入国债期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 15%;

2) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 100%。其中, 有价证券指股票、债券 (不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产 (不含质押式回购) 等;

3) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%; 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计 (轧差计算) 应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定; 基金所持有的债券 (不含到期日在一年以内的政府债券) 市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计 (轧差计算) 应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

5) 本基金在任何交易日内交易 (不包括平仓) 的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%; 在任何交易日内交易 (不包括平仓) 的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%。

(15) 因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%; 开仓卖出认购期权的, 应持有足额标的证券; 开仓卖出认沽期权的, 应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物; 未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中, 合约面值按照行权价乘以合约乘数计算; 基金投资股票期权符合基金合同约定的比例限制 (如股票仓位、个股占比等)、投资目标和风险收益特征;

(16) 本基金参与融资的, 每个交易日日终, 本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%;

(17) 本基金参与转融通证券出借交易, 在任何交易日日终, 参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%, 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天, 平均剩余期限按照市值加权平均计算;

(18) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(19) 本基金主动投资流动性受限资产的市值合计不得超过本基金基金资产净值的 15%; 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述投资比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(20) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对

手方开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(21) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(10)、(19)、(20)项规定的情形外,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资;
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

九、业绩比较基准

1、标的指数

本基金的标的指数为沪深 300 指数。

沪深 300 指数由中证指数有限公司编制并发布,反映中国证券市场股票价格变动的概貌和运行状况。

如果指数编制单位变更或停止沪深 300 指数的编制、发布或授权,或沪深 300 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致沪深 300 指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,基金管理人认为有必要作相应调整时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中,若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

2、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:

沪深 300 指数收益率 $\times 95\%$ + 银行人民币活期存款利率(税后) $\times 5\%$

如本基金标的指数变化,则业绩比较基准中的标的指数将相应调整。业绩比较基准的调整根据标的指数的变更程序执行。

十、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。

十一、基金投资组合报告

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的法律责任。

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 03 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 1 投资组合报告

1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	210,194,479.20	90.34
	其中：股票	210,194,479.20	90.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,200.00	0.00
	其中：债券	7,200.00	0.00
	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	20,264,783.78	8.71
8	其他各项资产	2,200,932.43	0.95
9	合计	232,667,395.41	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 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	3,142,137.60	1.36
B	采矿业	6,402,005.52	2.77
C	制造业	88,986,123.07	38.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,088,784.00	2.20
E	建筑业	5,403,826.76	2.34

F	批发和零售业	2,367,398.96	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	5,809,236.84	2.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,342,958.54	2.74
J	金融业	70,198,298.61	30.37
K	房地产业	9,165,852.83	3.97
L	租赁和商务服务业	2,523,524.85	1.09
M	科学研究和技术服务业	1,046,483.20	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	223,440.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	187,740.00	0.08
Q	卫生和社会工作	1,881,274.43	0.81
R	文化、体育和娱乐业	1,094,971.42	0.47
S	综合	-	-
	合计	209,864,056.63	90.80

1.2.2 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	165,691.49	0.07
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术	158,153.04	0.07

	服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	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	330,422.57	0.14

1.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

1.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	601318	中国平安	167,100	14,280,366.00	6.18
2	600519	贵州茅台	7,700	9,109,100.00	3.94
3	600036	招商银行	161,200	6,057,896.00	2.62
4	000651	格力电器	73,900	4,846,362.00	2.10
5	601166	兴业银行	227,300	4,500,540.00	1.95
6	000333	美的集团	75,000	4,368,750.00	1.89
7	600276	恒瑞医药	47,569	4,163,238.88	1.80
8	000858	五粮液	29,801	3,963,831.01	1.71
9	600030	中信证券	117,300	2,967,690.00	1.28
10	600887	伊利股份	93,734	2,900,129.96	1.25
11	000002	万科A	89,800	2,889,764.00	1.25
12	600900	长江电力	136,200	2,503,356.00	1.08
13	000001	平安银行	150,600	2,477,370.00	1.07
14	600016	民生银行	383,720	2,421,273.20	1.05
15	601328	交通银行	424,700	2,391,061.00	1.03
16	600000	浦发银行	183,100	2,264,947.00	0.98
17	601288	农业银行	595,470	2,197,284.30	0.95
18	601398	工商银行	335,400	1,972,152.00	0.85
19	300498	温氏股份	58,000	1,948,800.00	0.84
20	600837	海通证券	122,100	1,887,666.00	0.82
21	002415	海康威视	57,300	1,876,002.00	0.81
22	002475	立讯精密	50,201	1,832,336.50	0.79

23	601601	中国太保	48,200	1,823,888.00	0.79
24	601668	中国建筑	323,080	1,815,709.60	0.79
25	600048	保利地产	110,000	1,779,800.00	0.77
26	600585	海螺水泥	30,101	1,649,534.80	0.71
27	000725	京东方 A	360,500	1,636,670.00	0.71
28	600031	三一重工	90,800	1,548,140.00	0.67
29	601688	华泰证券	66,200	1,344,522.00	0.58
30	601888	中国国旅	14,999	1,334,161.05	0.58
31	603288	海天味业	12,400	1,333,124.00	0.58
32	600309	万华化学	23,600	1,325,612.00	0.57
33	601169	北京银行	229,300	1,302,424.00	0.56
34	600104	上汽集团	54,300	1,295,055.00	0.56
35	300059	东方财富	81,592	1,286,705.84	0.56
36	000063	中兴通讯	36,101	1,277,614.39	0.55
37	601211	国泰君安	67,900	1,255,471.00	0.54
38	002142	宁波银行	43,501	1,224,553.15	0.53
39	601988	中国银行	328,009	1,210,353.21	0.52
40	002714	牧原股份	13,440	1,193,337.60	0.52
41	600009	上海机场	14,900	1,173,375.00	0.51
42	000338	潍柴动力	73,400	1,165,592.00	0.50
43	600690	海尔智家	56,901	1,109,569.50	0.48
44	601818	光大银行	248,100	1,094,121.00	0.47
45	601766	中国中车	149,200	1,065,288.00	0.46
46	601229	上海银行	110,700	1,050,543.00	0.45
47	600028	中国石化	205,503	1,050,120.33	0.45
48	603259	药明康德	11,360	1,046,483.20	0.45
49	600919	江苏银行	144,000	1,042,560.00	0.45
50	002304	洋河股份	9,203	1,016,931.50	0.44
51	601012	隆基股份	40,836	1,013,957.88	0.44
52	000661	长春高新	2,200	983,400.00	0.43
53	601899	紫金矿业	213,400	979,506.00	0.42
54	002027	分众传媒	156,180	977,686.80	0.42
55	001979	招商蛇口	48,700	967,669.00	0.42
56	000568	泸州老窖	11,101	962,234.68	0.42
57	601088	中国神华	50,301	917,993.25	0.40
58	000100	TCL 科技	201,500	900,705.00	0.39
59	601628	中国人寿	25,500	889,185.00	0.38
60	601857	中国石油	150,200	875,666.00	0.38
61	600050	中国联通	143,300	844,037.00	0.37
62	002230	科大讯飞	23,700	817,176.00	0.35
63	601009	南京银行	92,600	812,102.00	0.35

64	600019	宝钢股份	137,700	790,398.00	0.34
65	600999	招商证券	43,000	786,470.00	0.34
66	600570	恒生电子	9,911	770,382.03	0.33
67	300015	爱尔眼科	19,130	756,782.80	0.33
68	601939	建设银行	104,290	754,016.70	0.33
69	601006	大秦铁路	91,400	750,394.00	0.32
70	601390	中国中铁	125,400	744,876.00	0.32
71	601989	中国重工	142,000	744,080.00	0.32
72	600015	华夏银行	95,400	731,718.00	0.32
73	600406	国电南瑞	33,700	713,766.00	0.31
74	002241	歌尔股份	35,601	709,171.92	0.31
75	601186	中国铁建	69,900	708,786.00	0.31
76	000166	申万宏源	136,600	699,392.00	0.30
77	000538	云南白药	7,808	698,269.44	0.30
78	600703	三安光电	37,701	692,190.36	0.30
79	000876	新希望	32,800	654,360.00	0.28
80	002594	比亚迪	13,702	653,174.34	0.28
81	600741	华域汽车	24,600	639,354.00	0.28
82	601336	新华保险	12,800	629,120.00	0.27
83	300142	沃森生物	19,000	616,360.00	0.27
84	002044	美年健康	41,167	612,976.63	0.27
85	603986	兆易创新	2,900	594,181.00	0.26
86	600958	东方证券	54,800	589,648.00	0.26
87	002024	苏宁易购	57,900	585,369.00	0.25
88	600352	浙江龙盛	39,601	573,026.47	0.25
89	002236	大华股份	28,200	560,616.00	0.24
90	601225	陕西煤业	61,800	555,582.00	0.24
91	600588	用友网络	19,317	548,602.80	0.24
92	300136	信维通信	11,900	540,022.00	0.23
93	300003	乐普医疗	16,300	539,204.00	0.23
94	600340	华夏幸福	18,600	533,820.00	0.23
95	002008	大族激光	13,301	532,040.00	0.23
96	000157	中联重科	79,200	529,056.00	0.23
97	600547	山东黄金	16,187	528,019.94	0.23
98	601901	方正证券	60,800	527,136.00	0.23
99	600346	恒力石化	32,460	521,956.80	0.23
100	600660	福耀玻璃	21,701	520,606.99	0.23
101	300347	泰格医药	8,100	511,515.00	0.22
102	601669	中国电建	117,200	508,648.00	0.22
103	002202	金风科技	42,540	508,353.00	0.22
104	601377	兴业证券	71,700	507,636.00	0.22

105	601138	工业富联	27,700	506,079.00	0.22
106	600436	片仔癀	4,600	505,402.00	0.22
107	600383	金地集团	34,800	504,600.00	0.22
108	002352	顺丰控股	13,400	498,346.00	0.22
109	300124	汇川技术	16,000	490,240.00	0.21
110	000069	华侨城 A	62,500	486,875.00	0.21
111	601985	中国核电	96,700	483,500.00	0.21
112	600886	国投电力	51,600	473,688.00	0.20
113	600029	南方航空	65,797	472,422.46	0.20
114	603993	洛阳钼业	107,700	469,572.00	0.20
115	600010	包钢股份	354,500	467,940.00	0.20
116	002736	国信证券	37,200	466,860.00	0.20
117	002001	新和成	19,900	462,874.00	0.20
118	002007	华兰生物	12,903	453,540.45	0.20
119	002456	欧菲光	29,000	452,400.00	0.20
120	601933	永辉超市	59,900	451,646.00	0.20
121	000895	双汇发展	15,500	449,965.00	0.19
122	601111	中国国航	45,602	441,883.38	0.19
123	601877	正泰电器	16,400	439,520.00	0.19
124	603160	汇顶科技	2,100	433,230.00	0.19
125	601108	财通证券	38,100	432,054.00	0.19
126	002555	三七互娱	16,001	430,906.93	0.19
127	002311	海大集团	11,800	424,800.00	0.18
128	600795	国电电力	181,200	424,008.00	0.18
129	000783	长江证券	59,000	421,260.00	0.18
130	002602	世纪华通	36,372	415,731.96	0.18
131	600018	上港集团	72,000	415,440.00	0.18
132	300144	宋城演艺	13,400	414,194.00	0.18
133	002466	天齐锂业	13,691	413,194.38	0.18
134	600196	复星医药	15,401	409,666.60	0.18
135	002460	赣锋锂业	11,651	405,804.33	0.18
136	600271	航天信息	17,300	400,841.00	0.17
137	600438	通威股份	30,400	399,152.00	0.17
138	600705	中航资本	82,200	398,670.00	0.17
139	600115	东方航空	68,300	396,823.00	0.17
140	000938	紫光股份	12,452	393,483.20	0.17
141	600606	绿地控股	56,400	391,980.00	0.17
142	603799	华友钴业	9,900	389,961.00	0.17
143	000425	徐工机械	71,200	389,464.00	0.17
144	601788	光大证券	29,600	387,760.00	0.17
145	603501	韦尔股份	2,700	387,180.00	0.17

146	600089	特变电工	57,700	383,705.00	0.17
147	601997	贵阳银行	40,020	382,591.20	0.17
148	600011	华能国际	68,500	382,230.00	0.17
149	600177	雅戈尔	54,080	376,937.60	0.16
150	600183	生益科技	17,700	370,284.00	0.16
151	300122	智飞生物	7,400	367,484.00	0.16
152	601555	东吴证券	36,700	366,633.00	0.16
153	600111	北方稀土	33,800	366,392.00	0.16
154	002050	三花智控	20,880	361,850.40	0.16
155	002493	荣盛石化	29,100	360,549.00	0.16
156	300033	同花顺	3,300	360,063.00	0.16
157	600061	国投资本	23,700	358,818.00	0.16
158	600809	山西汾酒	4,000	358,800.00	0.16
159	002271	东方雨虹	13,600	357,816.00	0.15
160	601600	中国铝业	100,400	355,416.00	0.15
161	300408	三环集团	15,900	354,252.00	0.15
162	002410	广联达	10,400	353,392.00	0.15
163	000768	中航飞机	21,400	350,532.00	0.15
164	600176	中国巨石	31,800	346,620.00	0.15
165	002624	完美世界	7,800	344,292.00	0.15
166	600109	国金证券	37,000	344,100.00	0.15
167	600487	亨通光电	20,580	334,630.80	0.14
168	002120	韵达股份	9,970	332,001.00	0.14
169	603019	中科曙光	9,600	331,968.00	0.14
170	601800	中国交建	35,801	327,937.16	0.14
171	000963	华东医药	13,445	327,789.10	0.14
172	601607	上海医药	17,800	326,986.00	0.14
173	000786	北新建材	12,800	325,760.00	0.14
174	002179	中航光电	8,260	322,635.60	0.14
175	601919	中远海控	60,400	318,308.00	0.14
176	600522	中天科技	38,100	316,230.00	0.14
177	600100	同方股份	35,900	314,843.00	0.14
178	002422	科伦药业	13,200	310,068.00	0.13
179	600516	方大炭素	25,308	307,745.28	0.13
180	601618	中国中冶	109,900	307,720.00	0.13
181	600332	白云山	8,603	306,352.83	0.13
182	000961	中南建设	29,000	305,950.00	0.13
183	000625	长安汽车	30,000	300,900.00	0.13
184	600893	航发动力	13,700	297,016.00	0.13
185	600637	东方明珠	31,552	295,326.72	0.13
186	601998	中信银行	47,700	294,309.00	0.13

187	600498	烽火通信	10,702	293,769.90	0.13
188	600066	宇通客车	20,500	292,125.00	0.13
189	600926	杭州银行	31,800	291,288.00	0.13
190	300017	网宿科技	30,502	290,684.06	0.13
191	000728	国元证券	30,800	285,516.00	0.12
192	600068	葛洲坝	42,000	280,560.00	0.12
193	300413	芒果超媒	8,020	280,379.20	0.12
194	601727	上海电气	55,800	277,884.00	0.12
195	603899	晨光文具	5,700	277,818.00	0.12
196	600004	白云机场	15,900	277,455.00	0.12
197	600867	通化东宝	21,800	275,770.00	0.12
198	601198	东兴证券	20,800	273,312.00	0.12
199	600362	江西铜业	15,902	269,220.86	0.12
200	600674	川投能源	27,200	267,920.00	0.12
201	002673	西部证券	26,702	261,679.60	0.11
202	002146	荣盛发展	26,601	261,487.83	0.11
203	601838	成都银行	28,100	254,867.00	0.11
204	600208	新湖中宝	66,900	252,882.00	0.11
205	000656	金科股份	32,700	251,136.00	0.11
206	600023	浙能电力	63,400	251,064.00	0.11
207	600583	海油工程	33,800	249,444.00	0.11
208	000423	东阿阿胶	7,002	247,660.74	0.11
209	601117	中国化学	38,400	247,296.00	0.11
210	600219	南山铝业	110,230	246,915.20	0.11
211	601021	春秋航空	5,600	245,784.00	0.11
212	600170	上海建工	69,300	245,322.00	0.11
213	002508	老板电器	7,202	243,499.62	0.11
214	000703	恒逸石化	17,300	240,816.00	0.10
215	600085	同仁堂	8,402	236,768.36	0.10
216	002601	龙蟠佰利	15,300	235,467.00	0.10
217	601018	宁波港	61,700	234,460.00	0.10
218	603833	欧派家居	2,000	234,000.00	0.10
219	300024	机器人	16,700	233,800.00	0.10
220	000596	古井贡酒	1,700	231,064.00	0.10
221	601881	中国银河	19,901	231,050.61	0.10
222	000630	铜陵有色	98,100	228,573.00	0.10
223	002916	深南电路	1,600	227,360.00	0.10
224	600489	中金黄金	26,800	227,264.00	0.10
225	002739	万达电影	12,500	226,875.00	0.10
226	601878	浙商证券	20,300	225,939.00	0.10
227	600369	西南证券	43,300	224,727.00	0.10

228	300070	碧水源	29,400	223,440.00	0.10
229	002081	金螳螂	24,600	216,972.00	0.09
230	000627	天茂集团	30,500	214,720.00	0.09
231	600038	中直股份	4,500	214,695.00	0.09
232	600535	天士力	13,904	214,399.68	0.09
233	000671	阳光城	24,600	209,100.00	0.09
234	601066	中信建投	6,700	203,680.00	0.09
235	600760	中航沈飞	6,400	202,240.00	0.09
236	600482	中国动力	10,101	202,020.00	0.09
237	600153	建发股份	22,100	198,679.00	0.09
238	000629	攀钢钒钛	66,800	195,056.00	0.08
239	600118	中国卫星	9,101	194,488.37	0.08
240	002032	苏泊尔	2,500	191,950.00	0.08
241	002153	石基信息	4,900	191,100.00	0.08
242	603156	养元饮品	6,520	189,275.60	0.08
243	600655	豫园股份	24,100	188,944.00	0.08
244	002607	中公教育	10,500	187,740.00	0.08
245	601992	金隅集团	50,300	187,619.00	0.08
246	600027	华电国际	50,600	185,702.00	0.08
247	600663	陆家嘴	13,400	181,034.00	0.08
248	000723	美锦能源	19,100	180,113.00	0.08
249	002938	鹏鼎控股	3,900	175,110.00	0.08
250	601808	中海油服	9,100	174,720.00	0.08
251	600977	中国电影	11,401	173,523.22	0.08
252	000709	河钢股份	65,800	169,764.00	0.07
253	300433	蓝思科技	12,150	167,913.00	0.07
254	601238	广汽集团	14,300	167,167.00	0.07
255	600297	广汇汽车	51,011	166,295.86	0.07
256	002558	巨人网络	9,200	166,152.00	0.07
257	601633	长城汽车	18,700	165,495.00	0.07
258	601216	君正集团	52,000	162,760.00	0.07
259	600398	海澜之家	20,600	158,208.00	0.07
260	600816	安信信托	34,120	151,492.80	0.07
261	600848	上海临港	6,100	149,755.00	0.06
262	002411	延安必康	9,501	148,500.63	0.06
263	002773	康弘药业	3,970	146,770.90	0.06
264	601360	三六零	6,200	145,762.00	0.06
265	601577	长沙银行	15,800	143,306.00	0.06
266	600188	兖州煤业	13,500	142,560.00	0.06
267	002010	传化智联	20,100	140,298.00	0.06
268	601898	中煤能源	27,800	139,556.00	0.06

269	002294	信立泰	6,400	127,616.00	0.06
270	600733	北汽蓝谷	21,800	127,312.00	0.06
271	000898	鞍钢股份	37,700	126,295.00	0.05
272	601319	中国人保	16,400	124,476.00	0.05
273	600998	九州通	8,600	121,690.00	0.05
274	600566	济川药业	5,000	120,900.00	0.05
275	600989	宝丰能源	12,500	118,875.00	0.05
276	600025	华能水电	27,800	117,316.00	0.05
277	600372	中航电子	8,101	115,358.24	0.05
278	600233	圆通速递	8,800	111,320.00	0.05
279	601236	红塔证券	6,100	102,297.00	0.04
280	002841	视源股份	1,100	94,270.00	0.04
281	600968	海油发展	31,400	92,002.00	0.04
282	002468	申通快递	4,600	89,700.00	0.04
283	601212	白银有色	23,204	85,390.72	0.04
284	002939	长城证券	5,200	72,072.00	0.03
285	601828	美凯龙	6,300	71,379.00	0.03
286	601698	中国卫通	6,300	71,316.00	0.03
287	603260	合盛硅业	2,220	65,423.40	0.03
288	600390	五矿资本	7,600	62,776.00	0.03
289	002945	华林证券	4,200	62,748.00	0.03
290	002958	青农商行	9,400	60,818.00	0.03
291	601162	天风证券	8,100	59,616.00	0.03
292	600928	西安银行	7,600	59,052.00	0.03
293	601298	青岛港	7,500	51,525.00	0.02
294	600299	安迪苏	4,500	49,770.00	0.02

1.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	688128	中国电研	9,027	158,153.04	0.07
2	688300	联瑞新材	3,164	126,053.76	0.05
3	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
4	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01
5	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	601318	中国平安	15,069,653.00	14.12
2	600519	贵州茅台	7,178,654.00	6.73
3	600036	招商银行	5,801,663.34	5.44
4	601166	兴业银行	4,504,171.00	4.22
5	000651	格力电器	4,293,236.00	4.02
6	000333	美的集团	4,193,225.11	3.93
7	300498	温氏股份	3,885,724.08	3.64
8	000858	五粮液	3,864,004.00	3.62
9	600276	恒瑞医药	3,803,578.17	3.56
10	600030	中信证券	2,916,776.00	2.73
11	600887	伊利股份	2,871,719.90	2.69
12	600900	长江电力	2,534,754.87	2.38
13	000002	万科A	2,520,274.00	2.36
14	601328	交通银行	2,507,543.00	2.35
15	600016	民生银行	2,421,967.00	2.27
16	000001	平安银行	2,318,164.00	2.17
17	600000	浦发银行	2,217,589.80	2.08
18	601288	农业银行	2,198,925.00	2.06
19	601398	工商银行	1,945,383.00	1.82
20	601668	中国建筑	1,919,959.00	1.80

注:本项“买入金额”按买入成交金额填列,不考虑相关交易费用。

1.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	10,958,708.50	10.27
2	600519	贵州茅台	5,324,042.75	4.99
3	600036	招商银行	4,235,367.00	3.97
4	000651	格力电器	3,215,953.08	3.01
5	000333	美的集团	2,994,368.19	2.81
6	601166	兴业银行	2,940,767.00	2.76
7	000858	五粮液	2,845,485.27	2.67
8	600276	恒瑞医药	2,819,301.60	2.64
9	600030	中信证券	2,150,077.75	2.02
10	600887	伊利股份	1,981,003.00	1.86
11	601328	交通银行	1,770,143.00	1.66
12	600016	民生银行	1,746,958.00	1.64
13	600000	浦发银行	1,675,336.00	1.57
14	000001	平安银行	1,655,523.00	1.55

15	601288	农业银行	1,574,489.00	1.48
16	300498	温氏股份	1,536,503.96	1.44
17	000002	万科A	1,462,764.00	1.37
18	601398	工商银行	1,423,318.00	1.33
19	600837	海通证券	1,348,737.00	1.26
20	601601	中国太保	1,342,498.16	1.26

注:本项“卖出金额”按卖出成交金额填列,不考虑相关交易费用。

1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	214,606,479.51
卖出股票收入(成交)总额	153,073,541.60

注:本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列,不考虑相关交易费用。

1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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)	7,200.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,200.00	0.00

1.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128088	深南转债	72	7,200.00	0.00

1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

1.8 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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

1.9 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。

1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2003	IF2003	3	3,707,820.00	189,855.00	-
IF2006	IF2006	4	4,939,680.00	331,860.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					521,715.00
股指期货投资本期收益 (元)					546,101.95
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					540,135.00

1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等,以降低交易成本和组合风险,提高投资效率。

1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

1.12 投资组合报告附注

1.12.1 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。

1.12.2 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。

1.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,038,656.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,767.15
5	应收申购款	1,152,509.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,200,932.43

1.12.4 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。

1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**1.12.5.1 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。

1.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688128	中国电研	158,153.04	0.07	新股流通受限
2	688300	联瑞新材	126,053.76	0.05	新股流通受限
3	002973	侨银环保	6,578.04	0.00	新股流通受限

十二、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

沪深 300 (LOF) A 份额:

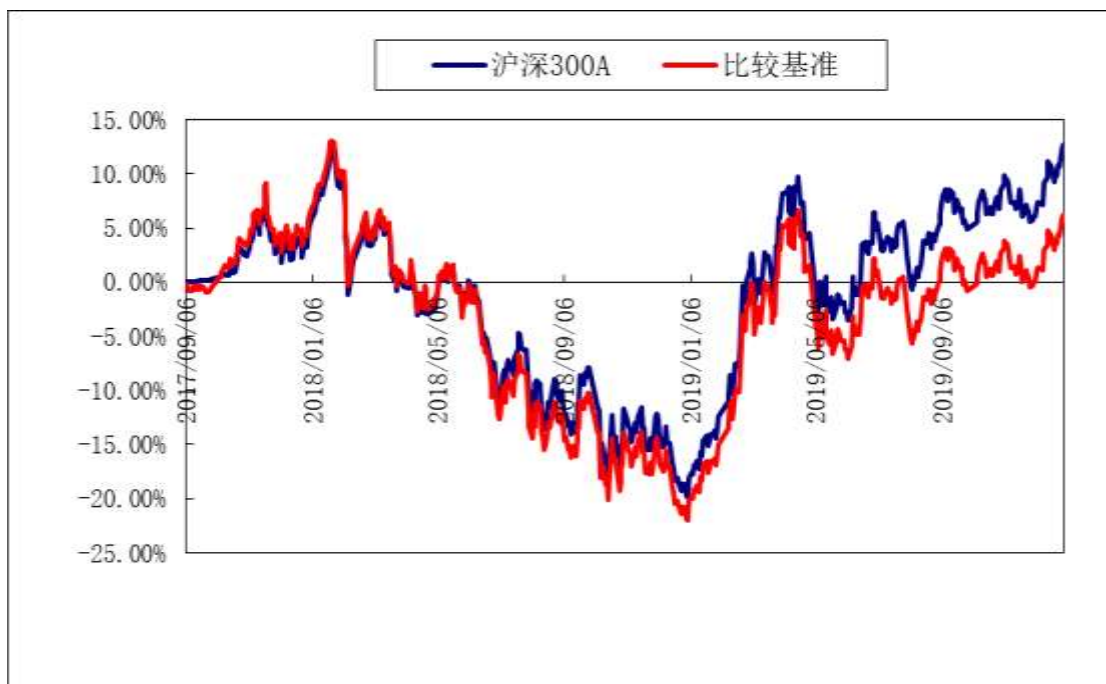
阶段	净值增长率 (1)	净值增长率 标准差 (2)	业绩比较 基准收益 率 (3)	业绩比较基 准收益率标 准差 (4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2017 年 9 月 6 日 (基 金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日	3.26%	0.65%	4.29%	0.68%	-1.03%	-0.03%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	-21.29%	1.28%	-24.12%	1.27%	2.83%	0.01%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	38.62%	1.18%	34.14%	1.18%	4.48%	0.00%
2017 年 9 月 6 日 (基 金合同生效日) 至 2019 年 12 月 31 日	12.67%	1.17%	6.15%	1.17%	6.52%	0.00%

沪深 300 (LOF) C 份额:

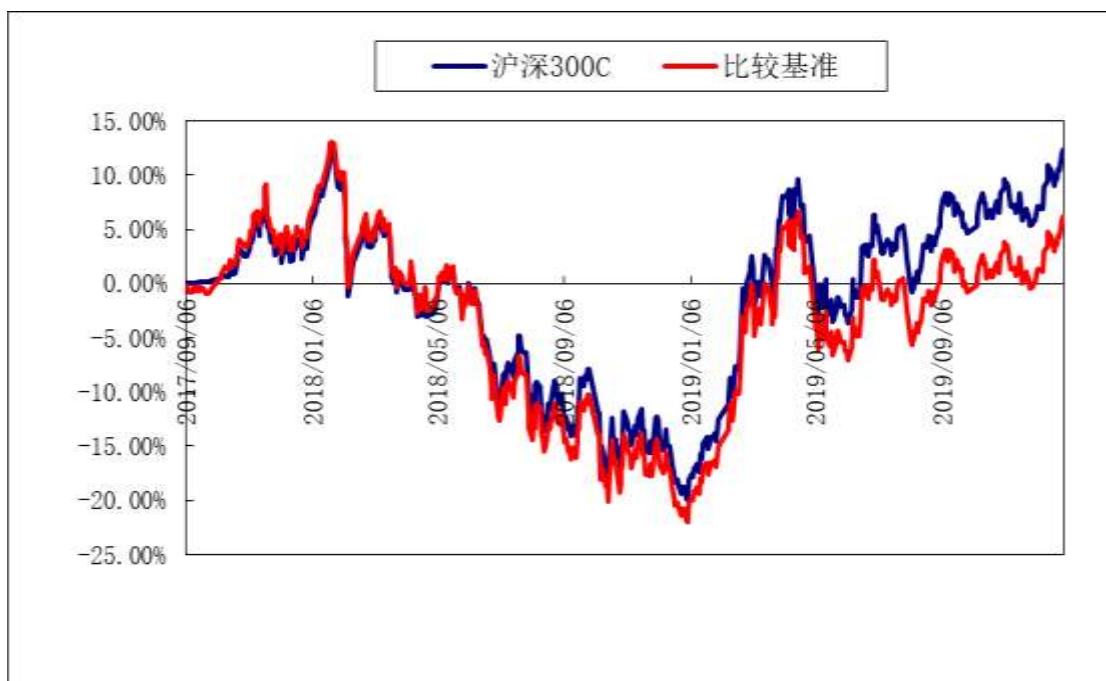
阶段	净值增长率 (1)	净值增长 率标准差 (2)	业绩比较基 准收益率 (3)	业绩比较基 准收益率标 准差 (4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2017 年 9 月 6 日 (基金 合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日	3.26%	0.65%	4.29%	0.68%	-1.03%	-0.03%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	-21.36%	1.28%	-24.12%	1.27%	2.76%	0.01%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	38.42%	1.18%	34.14%	1.18%	4.28%	0.00%
2017 年 9 月 6 日 (基金 合同生效日) 至 2019 年 12 月 31 日	12.40%	1.17%	6.15%	1.17%	6.25%	0.00%

(二) 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图

沪深 300 (LOF) A 份额:



沪深 300 (LOF) C 份额:



十三、基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费：本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；

- 4、基金标的指数许可使用费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金的上市费及年费；
- 11、基金的开户费用、账户维护费用；
- 12、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基

金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

计算方法如下:

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

4、基金的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提,计算方法如下:

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费从基金合同生效日开始每日计提,逐日累计,按季支付。由基金管理人向基金托管人发送标的指数的指数使用许可费划付指令,经基金托管人复核后,于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前 10 个工作日内将上季度标的指数使用许可费从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日或不可抗

力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 1 万元，若计费期间不足一季度的，则根据实际天数按比例计算该计费期间的收取下限。

如果指数使用许可协议约定的标的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露本基金最新适用的标的指数许可使用费率、具体计算方法及支付方式。

上述“一、基金费用的种类”中第 5—12 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

(一) 根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订，更新《招募说明书》前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的收益与分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容。

(二) 针对“基金管理人”章节：更新了基金管理人的相关信息。

- (三) 针对“基金托管人”章节：更新了基金托管人的相关信息。
- (四) 针对“基金的投资”章节：更新了基金的投资组合报告。
- (五) 针对“其他应披露事项”章节：更新了本基金的相关公告。

汇添富基金管理股份有限公司

2020 年 4 月 14 日