

深证 300 交易型开放式指数证券投资基金

更新招募说明书摘要

(2020 年 5 月 7 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：中国工商银行股份有限公司

重要提示

深证 300 交易型开放式指数证券投资基金（基金简称：汇添富深证 300ETF，基金代码：159912，以下简称“本基金”）经 2011 年 6 月 7 日中国证券监督管理委员会证监许可【2011】886 号文核准募集。本基金基金合同于 2011 年 9 月 16 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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

在投资本基金前，投资者应认真阅读本招募说明书，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：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，本基金的特定风险，等等。

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。

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。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不向投资者保证基金一定盈利,也不向投资者保证最低收益。

本基金招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本次招募说明书主要涉及标的指数使用许可费相关内容的更新,本招募说明书更新截止日为 2020 年 5 月 7 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: 中国证券监督管理委员会

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

赖中立先生，国籍：中国，学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士，13 年证券从业经验。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。

过蓓蓓女士，国籍：中国，学历：中国科学技术大学金融工程博士研究生，9 年证券从业经验。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。

（2）历任基金经理

吴振翔先生，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。

汪洋先生，2013年9月13日至2015年1月6日任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

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

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至 2019 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 208 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2019 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1006 只。自 2003 年以来，本行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 68 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

一、基金销售机构

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）

邮箱：guitai@htffund.com

网址：www.99fund.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、申购赎回代理券商

本基金的申购赎回代理券商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

3、二级市场交易代理券商

本基金办理二级市场交易业务的销售机构为具有基金销售业务资格、经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。具体会员单位名单可在深圳证券交易所网站查询。

（二）登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

联系人：严峰

电话：（0755）25946013

传真：（0755）25987122

（三）律师事务所和经办律师

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

负责人：俞卫锋

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

经办律师：吕红、黎明

联系人：陈颖华

（四）会计师事务所和经办注册会计师

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：深证 300 交易型开放式指数证券投资基金

基金简称：汇添富深证 300ETF

基金代码：159912

五、基金的类型

本基金为股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票

（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、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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）。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准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，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

1、决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理负责决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每

日申购赎回清单的编制决策。

3、投资程序

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合维护等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

(1) 研究支持：ETF 投资管理小组依托基金管理人整体研究平台，整合内外部信息和研究成果，开展对标的指数的跟踪研究、对标的指数成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、对标的指数成份股流动性分析、对基金的跟踪误差及时进行归因分析等工作，并撰写相关研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

(2) 投资决策：投资决策委员会依据 ETF 投资管理小组提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理在投资决策委员会决议的基础上，进行基金投资管理的日常决策。

(3) 组合构建：根据标的指数，结合 ETF 投资管理小组的研究报告，基金经理以完全复制标的指数的方法构建组合。在跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。

(4) 交易执行：中央交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

(5) 风险监控：风险控制人员根据实时风险监控系統，在交易期间对 ETF 的各类风险源进行监控，一旦发现异常立即通知基金经理，基金经理将根据风险的具体情况，确定相应的应急操作方案。

(6) 投资绩效评估：金融工程部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估将确认组合是否实现了投资预期、对跟踪误差和业绩偏离的来源进行分析，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。

(7) 组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股的流动性状况、基金申购和赎回情况以及组合投资绩效评估的分析结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理体制和程序做出调整，并在更新的招募说明书中公告。

(二) 投资组合管理

1、构建投资组合

制定建仓策略制定建仓策略和逐步组合调整。

本基金采取制定建仓策略和逐步组合调整。

本基金采取完全复制法确定目标组合，根据指数成份股的流动性和需买入数量建立基金的建仓策略，在基金合同生效之日起 3 个月内，按照建仓策略将不低于 90% 的基金资产投资于标的指数成份股、备选成份股。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在规定期限内进行调整。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如因流动性欠佳而无法完成建仓的某些成份股将采用合理方法寻求替代。

2、日常投资组合管理

(1) 可能引起跟踪误差各种因素的跟踪与分析：基金管理人将对标的指数成份股的调整、股本变化、分红、停/复牌、市场流动性、标的指数编制方法的变化、基金每日申购赎回情况等因素进行密切跟踪，分析其对指数跟踪的影响。

(2) 投资组合的调整：利用数量化分析模型，优选组合调整方案，并利用 ETF 投资管理系统适时调整投资组合，以实现更好的跟踪标的指数的目的。

对比指对比指数与组合的每日及累计的绩效数据，检测跟踪误差及其趋势：分析由于组合每只股票构成与指数构成的差异导致的跟踪误差的程度与趋势以找出跟踪误差的来源，进而决定需要对组合调整的部分及调整方法，并初步制定下一交易日的投资组合调整方案。

(4) 制作并公布申购赎回清单：以 T-1 日基金持有的证券及其比例为基础，根据上市公司公告，考虑 T 日可能发生的上市公司变动情况，制作 T 日的申购赎回清单并公告。

3、定期投资组合管理

基金管理人将定期（每月或每半年）进行投资组合管理，主要完成下列事项：

(1) 定期对投资组合的跟踪误差进行归因分析，制定改进方案，经投资决策委员会审批后实施；

(2) 根据标的指数的编制规则及调整公告，制定组合调整方案，经投资决策委员会审批后实施；

(3) 根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求, 及时检查组合中现金的比例, 进行每月支付现金的准备。

4、投资绩效评估

(1) 每日对基金的绩效评估进行, 主要是对跟踪偏离度和跟踪误差进行评估;

(2) 每月末, 金融工程部对本基金的运行情况进行量化评估;

(3) 每月末, 基金经理根据量化评估报告, 重点分析本基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金的控制情况、标的指数调整成份股前后的操作、未来成份股的变化等。

在正常市场情况下, 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%。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, 基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(三) 投资限制

1、本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%, 基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%, 基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的, 遵从其规定;

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

3、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%; 在任何交易日日终, 持有的买入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; 在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%; 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%; 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于交易保证金一倍的现金;

4、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；

5、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；

6、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

7、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律、法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的约定。

除上述第 4、5 项外，由于证券期货市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

(1) 承销证券；

(2) 向他人贷款或提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

(5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；

(6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人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；

(7) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

对于因上述（5）、（6）项情形导致无法投资的标的指数成份股或备选成份股，基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下，将结合使用其他合理方法进行适当替代。

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

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证 300 指数。

深证 300 指数于 2009 年 11 月 4 日发布，其对深圳 A 股初步筛选后的样本股，根据平均流通市值及平均成交金额进行综合排名，选取排名靠前 300 只股票组成样本。

如果指数编制单位变更或停止深证 300 指数的编制及发布、或深证成份指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致深证成份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时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。

十、基金的风险收益特征

本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、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。

十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国工商银行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	120,341,660.91	99.59
	其中：股票	120,341,660.91	99.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	58,400.00	0.05
	其中：债券	58,400.00	0.05
	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	431,865.49	0.36
8	其他各项资产	262.72	0.00
9	合计	120,832,189.12	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	4,156,784.80	3.45
B	采矿业	495,425.10	0.41
C	制造业	76,456,358.24	63.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	853,066.84	0.71
E	建筑业	426,713.62	0.35
F	批发和零售业	1,570,672.29	1.30
G	交通运输、仓储和邮政业	1,373,781.90	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,879,013.17	7.37
J	金融业	11,565,194.95	9.60
K	房地产业	7,237,398.51	6.00

L	租赁和商务服务业	2,067,149.88	1.72
M	科学研究和技术服务业	671,616.00	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	460,652.22	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	182,376.00	0.15
Q	卫生和社会工作	2,207,077.74	1.83
R	文化、体育和娱乐业	1,485,010.57	1.23
S	综合	253,369.08	0.21
	合计	120,341,660.91	99.84

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资。

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：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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	000651	格力电器	84,948	5,570,889.84	4.62
2	000333	美的集团	89,884	5,235,743.00	4.34
3	000858	五粮液	32,968	4,385,073.68	3.64
4	000002	万科A	104,698	3,369,181.64	2.80
5	000001	平安银行	168,621	2,773,815.45	2.30
6	300498	温氏股份	74,864	2,515,430.40	2.09
7	002415	海康威视	64,011	2,095,720.14	1.74
8	000725	京东方A	461,308	2,094,338.32	1.74
9	002475	立讯精密	57,323	2,092,289.50	1.74
10	000063	中兴通讯	44,883	1,588,409.37	1.32
11	300750	宁德时代	14,900	1,585,360.00	1.32
12	300059	东方财富	92,490	1,458,567.30	1.21

13	002142	宁波银行	48,982	1,378,843.30	1.14
14	300760	迈瑞医疗	7,400	1,346,060.00	1.12
15	000338	潍柴动力	81,724	1,297,777.12	1.08
16	002027	分众传媒	200,488	1,255,054.88	1.04
17	000661	长春高新	2,695	1,204,665.00	1.00
18	000568	泸州老窖	13,822	1,198,090.96	0.99
19	002714	牧原股份	13,360	1,186,234.40	0.98
20	002304	洋河股份	10,083	1,114,171.50	0.92
21	001979	招商蛇口	55,171	1,096,247.77	0.91
22	000100	TCL 科技	221,315	989,278.05	0.82
23	002230	科大讯飞	28,685	989,058.80	0.82
24	300015	爱尔眼科	23,747	939,431.32	0.78
25	000166	申万宏源	166,706	853,534.72	0.71
26	000776	广发证券	53,492	811,473.64	0.67
27	002241	歌尔股份	39,890	794,608.80	0.66
28	000876	新 希 望	37,606	750,239.70	0.62
29	300142	沃森生物	23,000	746,120.00	0.62
30	002594	比亚迪	14,893	709,949.31	0.59
31	000538	云南白药	7,858	702,740.94	0.58
32	300003	乐普医疗	20,906	691,570.48	0.57
33	002044	美年健康	46,328	689,823.92	0.57
34	300136	信维通信	14,900	676,162.00	0.56
35	002008	大族激光	15,740	629,600.00	0.52
36	002024	苏宁易购	62,225	629,094.75	0.52
37	002352	顺丰控股	16,800	624,792.00	0.52
38	300124	汇川技术	19,935	610,808.40	0.51
39	000157	中联重科	88,643	592,135.24	0.49
40	002236	大华股份	29,545	587,354.60	0.49
41	300347	泰格医药	9,150	577,822.50	0.48
42	002555	三七互娱	21,200	570,916.00	0.47
43	002456	欧菲光	35,895	559,962.00	0.46
44	002202	金风科技	46,176	551,803.20	0.46
45	002466	天齐锂业	18,115	546,710.70	0.45
46	000069	华侨城 A	69,781	543,593.99	0.45
47	000066	中国长城	34,036	529,600.16	0.44
48	000783	长江证券	72,699	519,070.86	0.43
49	002007	华兰生物	14,521	510,413.15	0.42
50	002736	国信证券	39,575	496,666.25	0.41
51	002001	新 和 成	21,114	491,111.64	0.41
52	002384	东山精密	21,150	489,622.50	0.41
53	002463	沪电股份	21,700	481,957.00	0.40

54	002460	赣锋锂业	13,700	477,171.00	0.40
55	000977	浪潮信息	15,803	475,670.30	0.39
56	300014	亿纬锂能	9,385	470,751.60	0.39
57	000860	顺鑫农业	8,850	466,218.00	0.39
58	002410	广联达	13,553	460,530.94	0.38
59	002311	海大集团	12,694	456,984.00	0.38
60	300122	智飞生物	9,200	456,872.00	0.38
61	002624	完美世界	10,200	450,228.00	0.37
62	300601	康泰生物	5,100	447,729.00	0.37
63	000425	徐工机械	78,698	430,478.06	0.36
64	300408	三环集团	19,300	430,004.00	0.36
65	000786	北新建材	16,344	415,954.80	0.35
66	300144	宋城演艺	13,387	413,792.17	0.34
67	002422	科伦药业	17,216	404,403.84	0.34
68	002271	东方雨虹	15,180	399,385.80	0.33
69	000768	中航飞机	24,320	398,361.60	0.33
70	300033	同花顺	3,632	396,287.52	0.33
71	002179	中航光电	10,080	393,724.80	0.33
72	300450	先导智能	8,691	390,573.54	0.32
73	000938	紫光股份	12,284	388,174.40	0.32
74	300383	光环新网	19,300	387,351.00	0.32
75	002129	中环股份	32,629	385,348.49	0.32
76	002439	启明星辰	11,320	382,616.00	0.32
77	002405	四维图新	23,591	379,815.10	0.32
78	002049	紫光国微	7,461	379,317.24	0.31
79	002157	正邦科技	23,400	379,080.00	0.31
80	000625	长安汽车	37,781	378,943.43	0.31
81	002050	三花智控	21,720	376,407.60	0.31
82	002493	荣盛石化	30,200	374,178.00	0.31
83	300012	华测检测	25,000	372,750.00	0.31
84	002065	东华软件	35,060	361,819.20	0.30
85	300088	长信科技	34,948	358,915.96	0.30
86	300413	芒果超媒	10,260	358,689.60	0.30
87	300207	欣旺达	18,200	355,264.00	0.29
88	002797	第一创业	42,820	354,549.60	0.29
89	000961	中南建设	33,340	351,737.00	0.29
90	002600	领益智造	32,300	350,455.00	0.29
91	000963	华东医药	14,173	345,537.74	0.29
92	002340	格林美	70,903	345,297.61	0.29
93	300253	卫宁健康	23,024	344,899.52	0.29
94	002371	北方华创	3,900	343,200.00	0.28

95	300454	深信服	3,000	343,170.00	0.28
96	002353	杰瑞股份	9,211	340,438.56	0.28
97	002821	凯莱英	2,600	336,700.00	0.28
98	002465	海格通信	30,830	333,888.90	0.28
99	000728	国元证券	36,006	333,775.62	0.28
100	300017	网宿科技	34,534	329,109.02	0.27
101	002127	南极电商	29,600	322,936.00	0.27
102	002673	西部证券	32,702	320,479.60	0.27
103	000750	国海证券	59,884	319,780.56	0.27
104	000596	古井贡酒	2,300	312,616.00	0.26
105	000656	金科股份	40,613	311,907.84	0.26
106	002146	荣盛发展	31,605	310,677.15	0.26
107	300024	机器人	22,084	309,176.00	0.26
108	000423	东阿阿胶	8,600	304,182.00	0.25
109	002506	协鑫集成	50,600	299,046.00	0.25
110	000703	恒逸石化	21,300	296,496.00	0.25
111	000988	华工科技	14,446	293,109.34	0.24
112	002185	华天科技	39,177	292,652.19	0.24
113	002601	龙蟠佰利	18,800	289,332.00	0.24
114	002508	老板电器	8,490	287,046.90	0.24
115	002120	韵达股份	8,543	284,481.90	0.24
116	002916	深南电路	2,000	284,200.00	0.24
117	000401	冀东水泥	16,700	284,067.00	0.24
118	300285	国瓷材料	12,400	283,340.00	0.24
119	002926	华西证券	25,400	279,654.00	0.23
120	002138	顺络电子	12,100	279,510.00	0.23
121	000050	深天马 A	16,903	275,349.87	0.23
122	300271	华宇软件	10,700	271,780.00	0.23
123	002195	二三四五	83,201	268,739.23	0.22
124	002602	世纪华通	23,080	263,804.40	0.22
125	000630	铜陵有色	113,135	263,604.55	0.22
126	002268	卫士通	10,220	263,573.80	0.22
127	002180	纳思达	8,000	263,360.00	0.22
128	002252	上海莱士	35,113	260,538.46	0.22
129	000623	吉林敖东	15,761	260,529.33	0.22
130	000413	东旭光电	77,265	259,610.40	0.22
131	002078	太阳纸业	26,000	255,840.00	0.21
132	000009	中国宝安	40,932	253,369.08	0.21
133	002373	千方科技	13,900	250,756.00	0.21
134	300296	利亚德	32,600	250,042.00	0.21
135	000671	阳光城	29,205	248,242.50	0.21

136	300070	碧水源	32,321	245,639.60	0.20
137	000686	东北证券	26,304	244,627.20	0.20
138	000540	中天金融	73,364	244,302.12	0.20
139	002500	山西证券	29,149	241,645.21	0.20
140	002939	长城证券	17,400	241,164.00	0.20
141	000513	丽珠集团	7,143	240,719.10	0.20
142	002507	涪陵榨菜	9,000	240,570.00	0.20
143	002739	万达电影	13,200	239,580.00	0.20
144	002032	苏泊尔	3,100	238,018.00	0.20
145	000895	双汇发展	8,118	235,665.54	0.20
146	000627	天茂集团	33,316	234,544.64	0.19
147	002812	恩捷股份	4,630	233,815.00	0.19
148	000998	隆平高科	15,848	233,124.08	0.19
149	002153	石基信息	5,938	231,582.00	0.19
150	002385	大北农	46,387	231,007.26	0.19
151	300529	健帆生物	3,200	229,888.00	0.19
152	002013	中航机电	32,908	228,381.52	0.19
153	300676	华大基因	3,300	226,710.00	0.19
154	002572	索菲亚	10,800	226,260.00	0.19
155	002223	鱼跃医疗	11,126	226,080.32	0.19
156	002081	金螳螂	25,522	225,104.04	0.19
157	000999	华润三九	7,012	222,140.16	0.18
158	300146	汤臣倍健	13,588	221,348.52	0.18
159	002019	亿帆医药	13,500	219,375.00	0.18
160	000997	新大陆	13,810	219,302.80	0.18
161	300558	贝达药业	3,300	216,810.00	0.18
162	000975	银泰黄金	15,800	215,038.00	0.18
163	300699	光威复材	4,700	213,850.00	0.18
164	002152	广电运通	22,160	212,957.60	0.18
165	300357	我武生物	4,800	211,920.00	0.18
166	300113	顺网科技	8,200	210,658.00	0.17
167	000878	云南铜业	15,123	206,580.18	0.17
168	002938	鹏鼎控股	4,600	206,540.00	0.17
169	300618	寒锐钴业	2,500	205,975.00	0.17
170	300251	光线传媒	17,306	204,210.80	0.17
171	000629	攀钢钒钛	69,900	204,108.00	0.17
172	000060	中金岭南	47,448	204,026.40	0.17
173	000830	鲁西化工	19,400	203,894.00	0.17
174	000709	河钢股份	78,900	203,562.00	0.17
175	300168	万达信息	13,188	203,490.84	0.17
176	300496	中科创达	4,500	203,130.00	0.17

177	300433	蓝思科技	14,619	202,034.58	0.17
178	000547	航天发展	19,733	201,671.26	0.17
179	002212	南洋股份	10,500	199,605.00	0.17
180	002281	光迅科技	6,700	199,526.00	0.17
181	002217	合力泰	35,800	198,690.00	0.16
182	002110	三钢闽光	21,050	197,028.00	0.16
183	002092	中泰化学	28,833	195,776.07	0.16
184	000778	新兴铸管	46,786	195,097.62	0.16
185	300058	蓝色光标	34,148	192,936.20	0.16
186	000581	威孚高科	10,077	191,966.85	0.16
187	300166	东方国信	14,760	191,880.00	0.16
188	002074	国轩高科	13,187	191,870.85	0.16
189	000723	美锦能源	20,100	189,543.00	0.16
190	000960	锡业股份	18,125	189,225.00	0.16
191	300274	阳光电源	17,600	185,328.00	0.15
192	000402	金融街	22,780	184,973.60	0.15
193	002368	太极股份	4,700	182,924.00	0.15
194	300747	锐科激光	1,550	182,590.00	0.15
195	002075	沙钢股份	29,300	182,539.00	0.15
196	002607	中公教育	10,200	182,376.00	0.15
197	002773	康弘药业	4,930	182,262.10	0.15
198	000983	西山煤电	29,070	178,199.10	0.15
199	300009	安科生物	11,800	178,062.00	0.15
200	000039	中集集团	18,127	178,007.14	0.15
201	000839	中信国安	50,210	177,743.40	0.15
202	300418	昆仑万维	10,600	177,550.00	0.15
203	002191	劲嘉股份	15,400	175,714.00	0.15
204	000690	宝新能源	31,073	175,562.45	0.15
205	002690	美亚光电	4,400	172,040.00	0.14
206	300316	晶盛机电	10,900	171,348.00	0.14
207	000089	深圳机场	17,400	169,998.00	0.14
208	002299	圣农发展	6,999	168,535.92	0.14
209	000825	太钢不锈	40,665	166,319.85	0.14
210	300308	中际旭创	3,180	165,837.00	0.14
211	002080	中材科技	13,200	163,680.00	0.14
212	300001	特锐德	9,500	163,210.00	0.14
213	002010	传化智联	23,000	160,540.00	0.13
214	000598	兴蓉环境	33,893	156,924.59	0.13
215	002511	中顺洁柔	12,300	155,718.00	0.13
216	000932	华菱钢铁	32,480	155,254.40	0.13
217	002085	万丰奥威	21,840	152,880.00	0.13

218	300628	亿联网络	2,100	152,061.00	0.13
219	000807	云铝股份	29,500	151,630.00	0.13
220	002670	国盛金控	11,900	151,249.00	0.13
221	000563	陕国投 A	34,100	151,063.00	0.13
222	002038	双鹭药业	11,442	150,462.30	0.12
223	003816	中国广核	41,500	149,400.00	0.12
224	000729	燕京啤酒	22,676	147,847.52	0.12
225	002595	豪迈科技	7,800	147,420.00	0.12
226	300595	欧普康视	3,100	146,723.00	0.12
227	002558	巨人网络	8,100	146,286.00	0.12
228	000883	湖北能源	35,043	146,129.31	0.12
229	002589	瑞康医药	18,700	143,803.00	0.12
230	300072	三聚环保	22,726	143,628.32	0.12
231	000898	鞍钢股份	41,840	140,164.00	0.12
232	002831	裕同科技	5,260	139,653.00	0.12
233	000031	大悦城	19,400	139,292.00	0.12
234	000738	航发控制	10,648	139,169.36	0.12
235	300133	华策影视	18,610	137,714.00	0.11
236	000046	泛海控股	30,218	137,491.90	0.11
237	002936	郑州银行	29,500	137,175.00	0.11
238	300188	美亚柏科	8,000	136,800.00	0.11
239	000415	渤海租赁	35,706	135,682.80	0.11
240	300180	华峰超纤	15,200	134,368.00	0.11
241	002294	信立泰	6,702	133,637.88	0.11
242	002151	北斗星通	5,200	131,248.00	0.11
243	000681	视觉中国	7,600	131,024.00	0.11
244	000559	万向钱潮	24,268	130,319.16	0.11
245	000027	深圳能源	20,969	130,217.49	0.11
246	002583	海能达	15,400	129,514.00	0.11
247	002056	横店东磁	15,700	128,740.00	0.11
248	002414	高德红外	6,100	128,100.00	0.11
249	300170	汉得信息	13,200	127,908.00	0.11
250	000826	启迪环境	13,609	124,930.62	0.10
251	002399	海普瑞	6,300	122,913.00	0.10
252	002372	伟星新材	9,200	121,164.00	0.10
253	002841	视源股份	1,400	119,980.00	0.10
254	002640	跨境通	15,500	119,660.00	0.10
255	300038	数知科技	13,800	118,956.00	0.10
256	002925	盈趣科技	2,700	118,665.00	0.10
257	002244	滨江集团	24,100	118,572.00	0.10
258	000732	泰禾集团	19,100	117,465.00	0.10

259	000887	中鼎股份	12,896	116,708.80	0.10
260	000028	国药一致	2,555	115,894.80	0.10
261	002262	恩华药业	9,900	115,137.00	0.10
262	002310	东方园林	22,795	114,430.90	0.09
263	002302	西部建设	9,700	109,513.00	0.09
264	000930	中粮科技	16,500	108,900.00	0.09
265	002563	森马服饰	10,800	106,596.00	0.09
266	002128	露天煤业	11,800	102,188.00	0.08
267	002242	九阳股份	4,000	100,640.00	0.08
268	001965	招商公路	11,400	99,978.00	0.08
269	002745	木林森	7,200	97,992.00	0.08
270	002468	申通快递	5,000	97,500.00	0.08
271	300616	尚品宅配	1,300	96,876.00	0.08
272	002408	齐翔腾达	13,400	95,810.00	0.08
273	002608	江苏国信	12,300	94,833.00	0.08
274	300748	金力永磁	2,400	93,504.00	0.08
275	000301	东方盛虹	17,600	91,168.00	0.08
276	000967	盈峰环境	14,600	90,082.00	0.07
277	002382	蓝帆医疗	7,200	87,408.00	0.07
278	002051	中工国际	8,969	87,178.68	0.07
279	002419	天虹股份	7,900	83,345.00	0.07
280	002424	贵州百灵	9,161	79,792.31	0.07
281	000987	越秀金控	8,000	77,360.00	0.06
282	300759	康龙化成	1,400	72,156.00	0.06
283	002958	青农商行	11,000	71,170.00	0.06
284	000990	诚志股份	4,800	71,136.00	0.06
285	300741	华宝股份	2,300	71,024.00	0.06
286	300773	拉卡拉	900	70,623.00	0.06
287	000564	供销大集	29,500	70,505.00	0.06
288	000553	安道麦 A	6,800	68,000.00	0.06
289	002653	海思科	3,300	67,188.00	0.06
290	000429	粤高速 A	7,800	64,428.00	0.05
291	000537	广宇发展	8,200	63,714.00	0.05
292	002867	周大生	3,300	62,832.00	0.05
293	300761	立华股份	900	53,460.00	0.04
294	002948	青岛银行	8,800	52,272.00	0.04
295	000959	首钢股份	13,900	49,067.00	0.04
296	002625	光启技术	5,300	48,495.00	0.04
297	001872	招商港口	1,900	32,604.00	0.03
298	000617	中油资本	2,600	31,642.00	0.03
299	002423	中粮资本	3,200	31,072.00	0.03

300	300766	每日互动	900	29,529.00	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

注:本基金本报告期末未持有积极投资。

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	300760	迈瑞医疗	990,697.00	1.36
2	300750	宁德时代	915,070.60	1.26
3	000002	万科A	553,481.00	0.76
4	002157	正邦科技	501,419.00	0.69
5	300012	华测检测	420,655.00	0.58
6	000333	美的集团	381,185.00	0.52
7	002027	分众传媒	379,086.00	0.52
8	001979	招商蛇口	373,461.88	0.51
9	300285	国瓷材料	314,496.00	0.43
10	000651	格力电器	306,488.00	0.42
11	300454	深信服	305,211.00	0.42
12	000629	攀钢钒钛	295,177.00	0.41
13	300271	华宇软件	284,644.00	0.39
14	002463	沪电股份	261,149.00	0.36
15	002939	长城证券	256,427.00	0.35
16	000975	银泰黄金	253,141.00	0.35
17	002352	顺丰控股	244,423.00	0.34
18	300357	我武生物	239,116.00	0.33
19	000938	紫光股份	232,912.00	0.32
20	300529	健帆生物	230,389.00	0.32

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	000651	格力电器	521,919.00	0.72
2	000858	五粮液	514,895.00	0.71
3	000895	双汇发展	336,787.00	0.46

4	000333	美的集团	326,277.00	0.45
5	300315	掌趣科技	316,579.72	0.44
6	000418	小天鹅 A	286,318.00	0.39
7	002450	*ST 康得	277,200.00	0.38
8	000970	中科三环	256,774.15	0.35
9	000503	国新健康	253,827.00	0.35
10	002221	东华能源	223,981.00	0.31
11	000661	长春高新	199,853.00	0.28
12	000725	京东方 A	193,535.00	0.27
13	002035	华帝股份	192,020.39	0.26
14	002023	海特高新	183,621.29	0.25
15	002273	水晶光电	179,671.76	0.25
16	300027	华谊兄弟	167,944.22	0.23
17	002415	海康威视	163,989.00	0.23
18	002407	多氟多	156,639.00	0.22
19	000338	潍柴动力	155,902.00	0.21
20	000877	天山股份	154,147.00	0.21

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	19,690,419.08
卖出股票收入(成交)总额	17,230,559.72

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)	58,400.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	58,400.00	0.05

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	128086	国轩转债	233	23,300.00	0.02
2	128084	木森转债	156	15,600.00	0.01
3	123036	先导转债	105	10,500.00	0.01
4	128088	深南转债	90	9,000.00	0.01

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。

1.10 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。

1.11 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。

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	169.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	92.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	262.72

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未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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

十二、基金的业绩

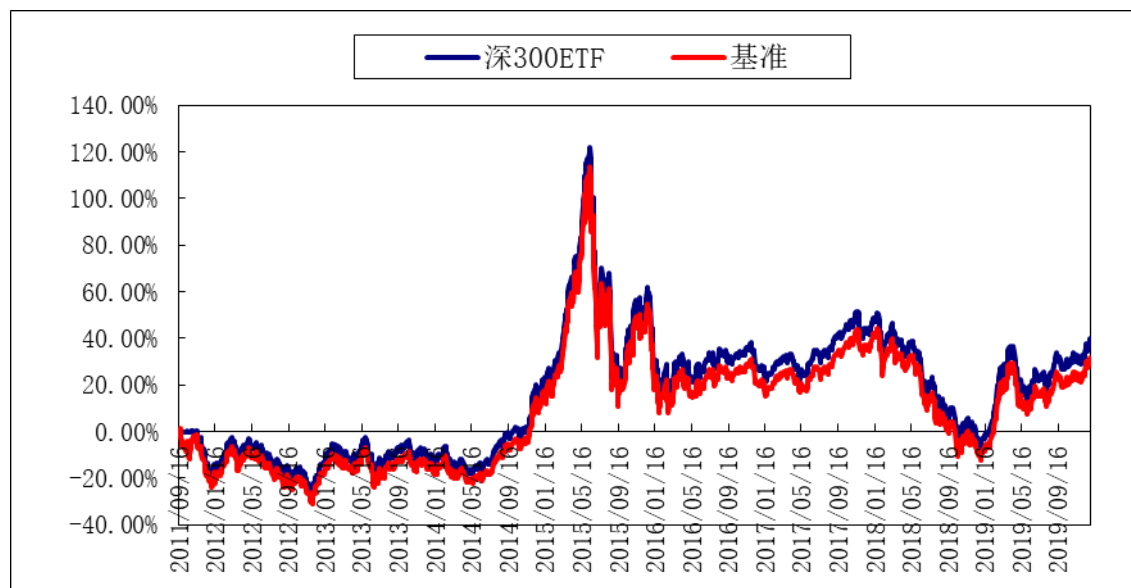
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(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：

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)
2011年9月16日(基 金合同生效日)至 2011年12月31日	-16.30%	0.98%	-20.05%	1.58%	3.75%	-0.60%

2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2.52%	1.42%	2.34%	1.44%	0.18%	-0.02%
2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	4.85%	1.38%	4.70%	1.39%	0.15%	-0.01%
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	30.29%	1.17%	30.66%	1.17%	-0.37%	0.00%
2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	32.55%	2.64%	32.63%	2.64%	-0.08%	0.00%
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	-18.93%	1.70%	-19.39%	1.75%	0.46%	-0.05%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	13.80%	0.86%	13.81%	0.86%	-0.01%	0.00%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	-33.95%	1.50%	-34.32%	1.51%	0.37%	-0.01%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	47.43%	1.44%	47.31%	1.46%	0.12%	-0.02%
2011 年 9 月 16 日(基 金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	39.59%	1.57%	31.76%	1.60%	7.83%	-0.03%

(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



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、基金的标的指数使用许可费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金上市费及年费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（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 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 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、公休假等，支付日期顺延。

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 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据

基金管理人的授权委托书,于次月前 2 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、公休日等,支付日期顺延。

3、基金的标的指数使用许可费

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标的指数许可方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 0.03% 的年费率计提,计算方法如下:

$$H=E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

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算,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 月将上季度标的指数使用许可费从基金财产中一次性支付。

本基金当季日均基金资产净值(日均基金资产净值=基金当季存续日的基金资产净值之和/基金当季存续天数,下同)大于人民币 5000 万元时,标的指数许可使用费的收取下限调整为每季度人民币 3.5 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。当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时,无标的指数许可使用费的收取下限。

如果指数使用许可协议约定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指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中或在其他公告中披露基金最新适用的方法或费率,并最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒介上刊登公告。此项变更无需召开基金份额持有人大会。

4、上述“一、基金费用的种类”中第 4—10 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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

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）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率或基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率等，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在指定媒介上公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，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） 针对“重要提示”章节：增加了本次招募说明书更新的主要事项和更新截止时间。
- （二） 针对“基金的费用与税收”章节：更新了基金的指数许可使用费。

汇添富基金管理股份有限公司

2020 年 5 月 7 日