汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金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:中国工商银行股份有限公司

重要提示

汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（基金简称:汇添富深证300ETF联接;基金代码:470068;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28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。

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,投资者拟认购（或申购）基金时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。本基金是股票型基金,属于证券投资基金中的高风险品种,其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。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。

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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。现任上海报业集团财务中心主任,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有限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。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日至今任汇添富中证医药ETF联接基金的基金经理,2019年4月15日至今任汇添富中证银行ETF联接基金的基金经理,2019年10月8日至今任汇添富中证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日任汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理。

汪洋先生,2013年9月13日至2015年1月6日任汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理。

5、投资决策委员会

主席:袁建军先生（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）基金份额销售机构

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、代销机构

本基金的代销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。

（二）注册登记机构

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）28932888

传真:（021）28932876

联系人:韩从慧

（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

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: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联接基金。

基金简称:汇添富深证300ETF联接

基金代码:470068

五、基金的类型

本基金为股票型证券投资基金（ETF联接基金）。

六、基金的投资目标

通过投资于目标ETF,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）、目标ETF、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（但需符合中国证监会的相关规定）。

本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股。其中投资于目标ETF的比例不少于基金资产净值的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券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。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

本基金以深证300交易型开放式指数证券投资基金作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。

本基金主要以一级市场申购的方式投资于目标ETF,获取基金份额净值上涨带来的收益;在目标ETF基金份额二级市场交易流动性较好的情况下,也可以通过二级市场买卖目标ETF的基金份额。

本基金建仓时间为6 个月,6个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。

1、资产配置策略

本基金采用自上而下的两层资产配置策略, 首先确定基金资产在权益类资产和现金或到期日在一年以内的政府债券之间的配置比例, 再进一步确定权益类资产中目标ETF和股票组合的配置比例。本基金将尽可能使持有的股票组合与标的指数的成分股结构保持一致,以实现对业绩比较基准的良好跟踪。本基金投资于目标ETF的资产比例将不低于基金资产净值的90%,权益类资产投资比例不超过基金资产净值的95%。

建仓期结束后,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0.3%,年跟踪误差不超过4%。在目标ETF 日均跟踪偏离度符合其基金合同所设定目标的前提下,如因指数编制规则调整等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,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

2、目标ETF的投资策略

（1）建仓期

基金合同生效后,本基金将主要按照标的指数的结构构建股票组合,并在建仓期内将股票组合换购成目标ETF,使本基金投资于目标ETF 的比例不低于基金资产净值的90%。

（2）日常运作期

本基金投资目标ETF有如下两种方式:

1）申购和赎回:目标ETF 开放申购赎回后,以股票组合进行申购赎回。

2）二级市场方式:目标ETF 上市交易后,在二级市场进行目标ETF 基金份额的交易。

当目标ETF 申购、赎回或二级市场交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。

（3）投资组合的调整

本基金将根据每个交易日申购赎回情况及本基金实际权益类资产仓位情况, 来决定对目标ETF的操作方式和数量。

1）当收到净申购时,本基金将根据净申购规模及实际权益类资产仓位情况,确定是否需要买入成份股,并申购目标ETF的操作;

2）当收到净赎回时,本基金将根据净赎回规模及及实际权益类资产仓位情况,确定是否需要对目标ETF进行赎回,并卖出赎回所得成份股;

3）在部分情况下,本基金将会根据目标ETF二级市场交易情况,适时选择对目标ETF进行二级市场交易操作。

（4）成份股、备选成份股投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股结构构建股票组合, 并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将考虑使用其他合理方法进行部分或全部替代。

（5）固定收益类资产投资策略

本基金固定收益类投资将主要用于现金管理, 对所选择的投资标的的流动性有较高的要求,选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。

(6)股指期货投资策略

本基金根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,有选择地投资于流动性好的期货合约。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

（二）投资决策依据和投资程序

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。

3、投资程序

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合维护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:金融工程部依托公司整体研究平台,整合内外部的信息和研究成果开展目标ETF申购赎回清单分析、目标ETF流动性分析、标的指数成份证券相关信息的搜集与分析,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金融工程部提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理的日常决策。

（3）交易执行:交易管理部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

（4）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。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合跟踪误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检视投资策略,进而调整投资组合。

（5）组合监控与调整:基金经理将跟踪目标ETF申购赎回清单特征、二级市场交易特征、标的指数变动情况,并结合成份股基本面情况、成份股公司行为、流动性状况、本基金申购和赎回的现金流量以及组合投资绩效评估的结果等, 对投资组合进行持续的监控和调整,以实现本基金的投资目标。

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程序做出调整,并在更新的招募说明书中公告。

（三）投资限制

1、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,但本基金投资目标ETF或者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但指定的目标ETF除外;

（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。

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。

2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

a、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%;

b、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;

c、现金和到期日不超过1年的政府债券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;

d、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%;

e、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%;

f、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%;

g、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;

h、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,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;

i、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;

j、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;

k、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;

l、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6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（c）、（i）、（j）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。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:深证300指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%

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300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, 或目标ETF标的指数发生变更,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,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水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,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及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	1,466,466.60	1.63
	其中:股票	1,466,466.60	1.63
2	基金投资	83,494,560.82	92.95
3	固定收益投资	200.00	0.00
	其中:债券	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	4,698,691.94	5.23
8	其他各项资产	169,282.75	0.19
9	合计	89,829,202.11	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

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	39,220.00	0.04
B	采矿业	8,880.00	0.01
C	制造业	895,135.00	1.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,633.00	0.02
E	建筑业	8,362.00	0.01
F	批发和零售业	22,396.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	17,840.00	0.02
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	131,570.00	0.15
J	金融业	142,091.00	0.16
K	房地产业	86,832.00	0.10
L	租赁和商务服务业	26,656.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	7,455.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	8,247.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	3,576.00	0.00
Q	卫生和社会工作	20,778.60	0.02
R	文化、体育和娱乐业	26,843.00	0.03
S	综合	4,952.00	0.01
	合计	1,466,466.60	1.64

1.2.2 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有港股通投资股票。

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

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	800	52,464.00	0.06
2	000333	美的集团	800	46,600.00	0.05
3	000002	万科A	1,000	32,180.00	0.04
4	000858	五粮液	200	26,602.00	0.03
5	000001	平安银行	1,500	24,675.00	0.03
6	300498	温氏股份	700	23,520.00	0.03
7	002475	立讯精密	570	20,805.00	0.02
8	002415	海康威视	600	19,644.00	0.02
9	000725	京东方A	4,300	19,522.00	0.02
10	000063	中兴通讯	400	14,156.00	0.02
11	300059	东方财富	800	12,616.00	0.01
12	002027	分众传媒	1,800	11,268.00	0.01
13	002142	宁波银行	400	11,260.00	0.01
14	000338	潍柴动力	700	11,116.00	0.01
15	002304	洋河股份	100	11,050.00	0.01
16	300750	宁德时代	100	10,640.00	0.01
17	000860	顺鑫农业	200	10,536.00	0.01
18	000783	长江证券	1,400	9,996.00	0.01
19	001979	招商蛇口	500	9,935.00	0.01
20	300122	智飞生物	200	9,932.00	0.01
21	000066	中国长城	600	9,336.00	0.01
22	002001	新和成	400	9,304.00	0.01
23	002384	东山精密	400	9,260.00	0.01
24	300450	先导智能	200	8,988.00	0.01
25	000100	TCL科技	2,000	8,940.00	0.01
26	300408	三环集团	400	8,912.00	0.01
27	002463	沪电股份	400	8,884.00	0.01
28	002714	牧原股份	100	8,879.00	0.01
29	002624	完美世界	200	8,828.00	0.01
30	002736	国信证券	700	8,785.00	0.01
31	000568	泸州老窖	100	8,668.00	0.01
32	000425	徐工机械	1,500	8,205.00	0.01
33	000768	中航飞机	500	8,190.00	0.01
34	300383	光环新网	400	8,028.00	0.01
35	300015	爱尔眼科	200	7,912.00	0.01
36	002271	东方雨虹	300	7,893.00	0.01
37	002179	中航光电	200	7,812.00	0.01
38	000166	申万宏源	1,500	7,680.00	0.01
39	000786	北新建材	300	7,635.00	0.01
40	000776	广发证券	500	7,585.00	0.01
41	300012	华测检测	500	7,455.00	0.01
42	002493	荣盛石化	600	7,434.00	0.01
43	002353	杰瑞股份	200	7,392.00	0.01
44	000963	华东医药	300	7,314.00	0.01
45	002065	东华软件	700	7,224.00	0.01
46	002311	海大集团	200	7,200.00	0.01
47	300088	长信科技	700	7,189.00	0.01
48	002129	中环股份	600	7,086.00	0.01
49	000423	东阿阿胶	200	7,074.00	0.01
50	002422	科伦药业	300	7,047.00	0.01
51	000625	长安汽车	700	7,021.00	0.01
52	300413	芒果超媒	200	6,992.00	0.01
53	002050	三花智控	400	6,932.00	0.01
54	002230	科大讯飞	200	6,896.00	0.01
55	002410	广联达	200	6,796.00	0.01
56	002508	老板电器	200	6,762.00	0.01
57	002439	启明星辰	200	6,760.00	0.01
58	002120	韵达股份	200	6,660.00	0.01
59	002797	第一创业	800	6,624.00	0.01
60	300003	乐普医疗	200	6,616.00	0.01
61	002180	纳思达	200	6,584.00	0.01
62	002044	美年健康	440	6,551.60	0.01
63	002127	南极电商	600	6,546.00	0.01
64	002600	领益智造	600	6,510.00	0.01
65	002465	海格通信	600	6,498.00	0.01
66	000728	国元证券	700	6,489.00	0.01
67	300142	沃森生物	200	6,488.00	0.01
68	002157	正邦科技	400	6,480.00	0.01
69	002405	四维图新	400	6,440.00	0.01
70	002340	格林美	1,300	6,331.00	0.01
71	000961	中南建设	600	6,330.00	0.01
72	000938	紫光股份	200	6,320.00	0.01
73	300347	泰格医药	100	6,315.00	0.01
74	300144	宋城演艺	200	6,182.00	0.01
75	000656	金科股份	800	6,144.00	0.01
76	300124	汇川技术	200	6,128.00	0.01
77	000988	华工科技	300	6,087.00	0.01
78	002024	苏宁易购	600	6,066.00	0.01
79	300253	卫宁健康	400	5,992.00	0.01
80	000876	新希望	300	5,985.00	0.01
81	002241	歌尔股份	300	5,976.00	0.01
82	002146	荣盛发展	600	5,898.00	0.01
83	002673	西部证券	600	5,880.00	0.01
84	000750	国海证券	1,100	5,874.00	0.01
85	300207	欣旺达	300	5,856.00	0.01
86	000895	双汇发展	200	5,806.00	0.01
87	300017	网宿科技	600	5,718.00	0.01
88	300024	机器人	400	5,600.00	0.01
89	000703	恒逸石化	400	5,568.00	0.01
90	002926	华西证券	500	5,505.00	0.01
91	002739	万达电影	300	5,445.00	0.01
92	002373	千方科技	300	5,412.00	0.01
93	002555	三七互娱	200	5,386.00	0.01
94	002507	涪陵榨菜	200	5,346.00	0.01
95	000157	中联重科	800	5,344.00	0.01
96	002506	协鑫集成	900	5,319.00	0.01
97	002185	华天科技	700	5,229.00	0.01
98	300308	中际旭创	100	5,215.00	0.01
99	002252	上海莱士	700	5,194.00	0.01
100	002268	卫士通	200	5,158.00	0.01
101	000401	冀东水泥	300	5,103.00	0.01
102	002049	紫光国微	100	5,084.00	0.01
103	300271	华宇软件	200	5,080.00	0.01
104	002812	恩捷股份	100	5,050.00	0.01
105	300014	亿纬锂能	100	5,016.00	0.01
106	000623	吉林敖东	300	4,959.00	0.01
107	000009	中国宝安	800	4,952.00	0.01
108	002078	太阳纸业	500	4,920.00	0.01
109	000630	铜陵有色	2,100	4,893.00	0.01
110	000050	深天马A	300	4,887.00	0.01
111	300146	汤臣倍健	300	4,887.00	0.01
112	002019	亿帆医药	300	4,875.00	0.01
113	002195	二三四五	1,500	4,845.00	0.01
114	002202	金风科技	400	4,780.00	0.01
115	002594	比亚迪	100	4,767.00	0.01
116	000997	新大陆	300	4,764.00	0.01
117	300595	欧普康视	100	4,733.00	0.01
118	002456	欧菲光	300	4,680.00	0.01
119	000069	华侨城A	600	4,674.00	0.01
120	000540	中天金融	1,400	4,662.00	0.01
121	000686	东北证券	500	4,650.00	0.01
122	002138	顺络电子	200	4,620.00	0.01
123	002601	龙蟒佰利	300	4,617.00	0.01
124	300296	利亚德	600	4,602.00	0.01
125	002602	世纪华通	400	4,572.00	0.01
126	300285	国瓷材料	200	4,570.00	0.01
127	300070	碧水源	600	4,560.00	0.01
128	300699	光威复材	100	4,550.00	0.01
129	300136	信维通信	100	4,538.00	0.01
130	300496	中科创达	100	4,514.00	0.01
131	002938	鹏鼎控股	100	4,490.00	0.01
132	002385	大北农	900	4,482.00	0.01
133	300357	我武生物	100	4,415.00	0.00
134	000998	隆平高科	300	4,413.00	0.00
135	002081	金螳螂	500	4,410.00	0.00
136	000671	阳光城	500	4,250.00	0.00
137	000627	天茂集团	600	4,224.00	0.00
138	000830	鲁西化工	400	4,204.00	0.00
139	002572	索菲亚	200	4,190.00	0.00
140	002013	中航机电	600	4,164.00	0.00
141	002939	长城证券	300	4,158.00	0.00
142	300433	蓝思科技	300	4,146.00	0.00
143	002500	山西证券	500	4,145.00	0.00
144	000878	云南铜业	300	4,098.00	0.00
145	000547	航天发展	400	4,088.00	0.00
146	000975	银泰黄金	300	4,083.00	0.00
147	002223	鱼跃医疗	200	4,064.00	0.00
148	002008	大族激光	100	4,000.00	0.00
149	002236	大华股份	200	3,976.00	0.00
150	002690	美亚光电	100	3,910.00	0.00
151	002153	石基信息	100	3,900.00	0.00
152	300166	东方国信	300	3,900.00	0.00
153	002368	太极股份	100	3,892.00	0.00
154	002217	合力泰	700	3,885.00	0.00
155	000060	中金岭南	900	3,870.00	0.00
156	000709	河钢股份	1,500	3,870.00	0.00
157	002152	广电运通	400	3,844.00	0.00
158	000581	威孚高科	200	3,810.00	0.00
159	002212	南洋股份	200	3,802.00	0.00
160	000629	攀钢钒钛	1,300	3,796.00	0.00
161	000723	美锦能源	400	3,772.00	0.00
162	000778	新兴铸管	900	3,753.00	0.00
163	002110	三钢闽光	400	3,744.00	0.00
164	002352	顺丰控股	100	3,719.00	0.00
165	002773	康弘药业	100	3,697.00	0.00
166	002558	巨人网络	200	3,612.00	0.00
167	002607	中公教育	200	3,576.00	0.00
168	300251	光线传媒	300	3,540.00	0.00
169	002007	华兰生物	100	3,515.00	0.00
170	002460	赣锋锂业	100	3,483.00	0.00
171	300001	特锐德	200	3,436.00	0.00
172	002191	劲嘉股份	300	3,423.00	0.00
173	002092	中泰化学	500	3,395.00	0.00
174	000690	宝新能源	600	3,390.00	0.00
175	300058	蓝色光标	600	3,390.00	0.00
176	000513	丽珠集团	100	3,370.00	0.00
177	300418	昆仑万维	200	3,350.00	0.00
178	000825	太钢不锈	800	3,272.00	0.00
179	000402	金融街	400	3,248.00	0.00
180	000839	中信国安	900	3,186.00	0.00
181	000999	华润三九	100	3,168.00	0.00
182	300274	阳光电源	300	3,159.00	0.00
183	300316	晶盛机电	200	3,144.00	0.00
184	000960	锡业股份	300	3,132.00	0.00
185	002075	沙钢股份	500	3,115.00	0.00
186	300168	万达信息	200	3,086.00	0.00
187	000983	西山煤电	500	3,065.00	0.00
188	300009	安科生物	200	3,018.00	0.00
189	000977	浪潮信息	100	3,010.00	0.00
190	002281	光迅科技	100	2,978.00	0.00
191	300133	华策影视	400	2,960.00	0.00
192	000039	中集集团	300	2,946.00	0.00
193	000089	深圳机场	300	2,931.00	0.00
194	000883	湖北能源	700	2,919.00	0.00
195	002074	国轩高科	200	2,910.00	0.00
196	000932	华菱钢铁	600	2,868.00	0.00
197	002085	万丰奥威	400	2,800.00	0.00
198	002010	传化智联	400	2,792.00	0.00
199	000598	兴蓉环境	600	2,778.00	0.00
200	000898	鞍钢股份	800	2,680.00	0.00
201	000415	渤海租赁	700	2,660.00	0.00
202	000563	陕国投A	600	2,658.00	0.00
203	002831	裕同科技	100	2,655.00	0.00
204	300180	华峰超纤	300	2,652.00	0.00
205	002372	伟星新材	200	2,634.00	0.00
206	002038	双鹭药业	200	2,630.00	0.00
207	000738	航发控制	200	2,614.00	0.00
208	000729	燕京啤酒	400	2,608.00	0.00
209	300038	数知科技	300	2,586.00	0.00
210	000807	云铝股份	500	2,570.00	0.00
211	300113	顺网科技	100	2,569.00	0.00
212	002670	国盛金控	200	2,542.00	0.00
213	002511	中顺洁柔	200	2,532.00	0.00
214	300072	三聚环保	400	2,528.00	0.00
215	002151	北斗星通	100	2,524.00	0.00
216	002583	海能达	300	2,523.00	0.00
217	003816	中国广核	700	2,520.00	0.00
218	002242	九阳股份	100	2,516.00	0.00
219	000027	深圳能源	400	2,484.00	0.00
220	002080	中材科技	200	2,480.00	0.00
221	002056	横店东磁	300	2,460.00	0.00
222	002244	滨江集团	500	2,460.00	0.00
223	002299	圣农发展	100	2,408.00	0.00
224	002262	恩华药业	200	2,326.00	0.00
225	002936	郑州银行	500	2,325.00	0.00
226	002640	跨境通	300	2,316.00	0.00
227	002589	瑞康医药	300	2,307.00	0.00
228	000046	泛海控股	500	2,275.00	0.00
229	002302	西部建设	200	2,258.00	0.00
230	000031	大悦城	300	2,154.00	0.00
231	000559	万向钱潮	400	2,148.00	0.00
232	002408	齐翔腾达	300	2,145.00	0.00
233	002414	高德红外	100	2,100.00	0.00
234	002310	东方园林	400	2,008.00	0.00
235	002294	信立泰	100	1,994.00	0.00
236	000930	中粮科技	300	1,980.00	0.00
237	002563	森马服饰	200	1,974.00	0.00
238	002399	海普瑞	100	1,951.00	0.00
239	002468	申通快递	100	1,950.00	0.00
240	002051	中工国际	200	1,944.00	0.00
241	300170	汉得信息	200	1,938.00	0.00
242	002867	周大生	100	1,904.00	0.00
243	002595	豪迈科技	200	1,890.00	0.00
244	000967	盈峰环境	300	1,851.00	0.00
245	000732	泰禾集团	300	1,845.00	0.00
246	000826	启迪环境	200	1,836.00	0.00
247	000887	中鼎股份	200	1,810.00	0.00
248	001965	招商公路	200	1,754.00	0.00
249	002424	贵州百灵	200	1,742.00	0.00
250	002128	露天煤业	200	1,732.00	0.00
251	000681	视觉中国	100	1,724.00	0.00
252	300188	美亚柏科	100	1,710.00	0.00
253	000301	东方盛虹	300	1,554.00	0.00
254	002608	江苏国信	200	1,542.00	0.00
255	000990	诚志股份	100	1,482.00	0.00
256	000564	供销大集	600	1,434.00	0.00
257	002745	木林森	100	1,361.00	0.00
258	002958	青农商行	200	1,294.00	0.00
259	002382	蓝帆医疗	100	1,214.00	0.00
260	002948	青岛银行	200	1,188.00	0.00
261	000959	首钢股份	300	1,059.00	0.00
262	002419	天虹股份	100	1,055.00	0.00
263	000553	安道麦A	100	1,000.00	0.00
264	002423	中粮资本	100	971.00	0.00
265	000987	越秀金控	100	967.00	0.00
266	002625	光启技术	100	915.00	0.00
267	000429	粤高速A	100	826.00	0.00
268	000537	广宇发展	100	777.00	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	000333	美的集团	1,930,191.50	3.33
2	000651	格力电器	1,923,953.86	3.32
3	000858	五粮液	1,426,048.00	2.46
4	300498	温氏股份	1,309,211.24	2.26
5	000002	万科A	1,216,103.00	2.10
6	002415	海康威视	1,104,976.00	1.91
7	000001	平安银行	1,013,055.00	1.75
8	000725	京东方A	960,382.00	1.66
9	000063	中兴通讯	694,617.00	1.20
10	300059	东方财富	689,805.00	1.19
11	002304	洋河股份	563,802.00	0.97
12	002230	科大讯飞	542,821.00	0.94
13	002475	立讯精密	533,545.00	0.92
14	002027	分众传媒	502,626.00	0.87
15	002142	宁波银行	486,098.82	0.84
16	000568	泸州老窖	475,028.00	0.82
17	000338	潍柴动力	468,081.00	0.81
18	000776	广发证券	420,052.00	0.72
19	002594	比亚迪	409,831.12	0.71
20	000538	云南白药	397,297.00	0.69

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	000333	美的集团	1,935,179.00	3.34
2	000651	格力电器	1,893,457.00	3.27
3	000858	五粮液	1,421,819.14	2.45
4	300498	温氏股份	1,166,414.08	2.01
5	000002	万科A	1,144,603.00	1.97
6	002415	海康威视	989,266.00	1.71
7	000001	平安银行	961,524.40	1.66
8	000725	京东方A	842,306.00	1.45
9	000063	中兴通讯	611,676.80	1.06
10	300059	东方财富	581,609.59	1.00
11	002475	立讯精密	570,614.50	0.98
12	002304	洋河股份	519,988.00	0.90
13	000568	泸州老窖	492,104.00	0.85
14	002027	分众传媒	483,491.20	0.83
15	002142	宁波银行	466,394.80	0.80
16	002230	科大讯飞	456,523.00	0.79
17	000338	潍柴动力	449,723.00	0.78
18	001979	招商蛇口	373,700.00	0.64
19	000538	云南白药	367,672.00	0.63
20	002594	比亚迪	362,007.00	0.62

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	47,720,820.14
卖出股票收入（成交）总额	44,121,400.31

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）	200.00	0.00
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	200.00	–

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	123036	先导转债	2	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。

1.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	深300ETF	指数	交易型开放式(ETF)	汇添富基金管理股份有限公司	83,494,560.82	93.46

1.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未有投资股指期货。

1.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货

1.13 投资组合报告附注

1.13.1 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。

1.13.2 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。

1.13.3 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	6,173.23
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	970.11
5	应收申购款	162,139.41
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	169,282.75

1.13.4 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。

1.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

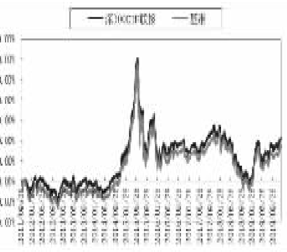
十二、基金的业绩

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28日（基金合同生效日）至2011年12月31日	–8.84%	0.67%	–16.22%	1.47%	7.38%	–0.80%
2012年1月1日至2012年12月31日	2.56%	1.32%	2.25%	1.37%	0.31%	–0.05%
2013年1月1日至2013年12月31日	4.13%	1.30%	4.48%	1.32%	–0.35%	–0.02%
2014年1月1日至2014年12月31日	26.70%	1.10%	29.15%	1.12%	–2.45%	–0.02%
2015年1月1日至2015年12月31日	29.04%	2.46%	31.01%	2.51%	–1.97%	–0.05%
2016年1月1日至2016年12月31日	–18.32%	1.62%	–18.40%	1.66%	0.08%	–0.04%
2017年1月1日至2017年12月31日	12.41%	0.81%	13.14%	0.82%	–0.73%	–0.01%
2018年1月1日至2018年12月31日	–32.08%	1.41%	–32.59%	1.44%	0.51%	–0.03%
2019年1月1日至2019年12月31日	44.14%	1.35%	44.96%	1.39%	–0.82%	–0.04%
2011年9月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日	43.06%	1.47%	34.99%	1.52%	8.07%	–0.05%

（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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券交易费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、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

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF份额所对应的资产净值后的余额（若为负数,则取0）的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H＝E×0.5%÷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扣除所持有目标ETF份额所对应的资产净值后的余额,若为负数,则E取0

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。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

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF份额所对应的资产净值后的余额（若为负数,则取0）的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H＝E×0.1%÷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扣除所持有目标ETF份额所对应的资产净值后的余额,若为负数,则E取0

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。

上述一、基金费用的种类中第3－8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、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、基金托管费率,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日在至少一种指定媒体上公告。

(五)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"基金的业绩"章节:更新了基金的业绩。

（六）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