汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2019年第二季度报告

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
报告送出日期:2019年7月17日

§1 重要提示

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2019年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富深证300ETF联接
基金主代码	470068
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月28日
报告期末基金份额总额	66,262,753.42份
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。
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,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。
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%
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。
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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159012
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011-09-16
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011-11-24
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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
投资策略	本基金主要采取完全复制法。正常情况下,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%
业绩比较基准	深证300指数收益率
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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	136,478.80
2.本期利润	-4,645,318.44
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0677
4.期末基金资产净值	83,342,006.48
5.期末基金份额净值	1.2578

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

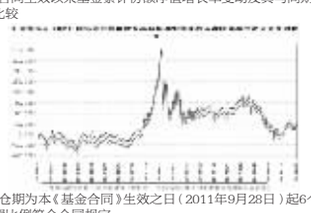
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-5.38%	1.69%	-6.15%	1.74%	0.77%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2011年9月28日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
过蓉蓉	汇添富中证主要消费ETF、汇添富中证医药卫生ETF、汇添富中证能源ETF、汇添富中证金融地产ETF、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富主要消费ETF联接基金、汇添富中证生物科技指数(LOF)基金、汇添富中证中药指数(LOF)基金、汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF)基金、中证银行ETF基金、添富中证医药ETF联接基金、添富中证银行ETF联接基金的基金经理。	2015年8月18日	-	8年	国籍:中国,学历:中国科学技术大学金融工程博士研究生,相关业务资格:证券投资基金从业资格。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。
赖中立	汇添富黄金及贵金属基金(LOF)的基金经理、汇添富恒生指数分级(ODII)基金、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富中证环境治理指数(LOF)基金、汇添富优选回报混合基金、汇添富中证港股通高股息投资指数(LOF)基金的基金经理。	2015年1月6日	-	12年	国籍:中国,学历:北京大学中国经济研究中心金融学硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历: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(ODII)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9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15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。

注:1、基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理,涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为3次,由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年2季度,A股市场行情焦灼,大盘价值股体现出明显的抗跌性,沪深300二季度微跌1.21%,创业板跌幅达10.75%。行业板块方面,食品饮料涨幅12.14%,远超其他行业,传媒行业二季度下跌15.79%,成为拖累创业板指的重要因素。5月长假结束后第一天,市场因为特朗普突然发布拟提高关税的言论引发市场大跌。6月末G20峰会上中美元首会晤使得中美贸易摩擦取得阶段性缓和,市场风险偏好明显提升。

二季度外围市场货币环境较好,除包商银行事件短期内引发银行间信用利差分层之外,国内流动性保持合理宽松。通胀在二季度走高,主要是因为食品CPI贡献,而经济运行数据显示出贸易摩擦及全球经济增长放缓对国内经济的影响,除社会消费品零售数据表现尚可,其余数据均低于预期。因此,宏观调控方面政策仍然重点实施逆周期调节,通过财政减税降费和货币政策保持流动性合理充裕,以对经济形成一定的支撑。但资本市场二季度悲观预期增强,直到中美领导会晤才打破二季度的震荡。资本市场方面,金融开放是半年度的主题词,加之科创板的推出,资本市场下半年波动性有可能进一步提高。

深证300指数今年上半年上涨28.43%,高于沪深300指数涨幅。本基金在报告期内遵循了指数基金的被动投资原则,保持了指数基金的本质属性,股票及标的ETF投资仓位在考察期内始终保持在90%-95%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。本基金日常管理中非常重视风险管理,对股票和现金头寸严格管理、实时监控,基本实现了基金平稳运作管理的目的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.2578元;本报告期基金份额净值增长率为-5.38%,业绩比较基准收益率为-6.15%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	365,108.00	0.44
	其中:股票	365,108.00	0.44
2	基金投资	78,667,717.89	93.97
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,600,580.87	5.50
8	其他资产	79,787.79	0.10
9	合计	83,713,194.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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	23,809.00	0.03
B	采矿业	-	-
C	制造业	238,554.00	0.29
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	7,188.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,396.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,833.00	0.03
J	金融业	34,089.00	0.04
K	房地产业	25,736.00	0.03
L	租赁和商务服务业	7,406.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,097.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	365,108.00	0.44

5.2.2 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持有港股通股票投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	600	33,000.00	0.04
2	000333	美的集团	600	31,116.00	0.04
3	000858	五粮液	200	23,590.00	0.03
4	300498	温氏股份	500	17,930.00	0.02
5	000002	万科A	600	16,686.00	0.02
6	002415	海康威视	500	13,790.00	0.02
7	000001	平安银行	1,000	13,780.00	0.02
8	002304	洋河股份	100	12,156.00	0.01
9	000725	京东方A	3,200	11,008.00	0.01
10	000063	中兴通讯	300	9,759.00	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	深300ETF	股票型	交易型开放式	汇添富基金管理股份有限公司	78,667,717.89	94.39

5.10 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。

5.11 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

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。

5.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,222.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	843.49
5	应收申购款	63,721.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,787.79

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	70,610,801.89
报告期期间基金总申购份额	20,229,175.22
减:报告期期间基金总赎回份额	24,577,223.69
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	66,262,753.42

注:总申购份额含红利再投,转换入份额,总赎回份额含转换出份额

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件;

2、《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合同》;

3、《汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、报告期内汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金在指定报刊上披露的各项公告;

6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼20楼汇添富基金管理股份有限公司

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,或登录基金管理人网站www.99fund.com查阅,还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-888-9918查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司
2019年7月17日

汇添富实业债债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富实业债债券
基金主代码	000122
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月14日
报告期末基金份额总额	119,451,368.04份
投资目标	在严格管理风险和保持资产流动性的基础上,努力实现资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%;其中对实业债的投资比例不低于债券类资产的90%,实业债指以生产制造和基础设施为主业的企业所发行的债券,包括公司债、企业债(含城投债)、可转换债券、可分离债券、短期融资券(不含金融企业短期融资券)、中期票据和中小企业私募债券;基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	汇添富实业债债券A / 汇添富实业债债券C
下属分级基金的交易代码	000122 / 000123
报告期末下属分级基金的份额总额	102,272,455.75份 / 17,178,912.29份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)	
	汇添富实业债债券A	汇添富实业债债券C
1.本期已实现收益	1,665,776.04	270,917.05
2.本期利润	-903,105.31	-174,412.18
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0086	-0.0093
4.期末基金资产净值	116,237,270.72	18,952,265.79
5.期末基金份额净值	1.137	1.103

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金自2014年6月18日起增加C类收费模式,该类收费模式不收取申购费,而是从基金资产中计提销售服务费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

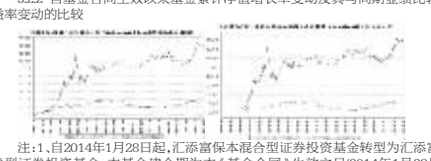
双利债券A

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
过去三个月	3.90%	0.44%	-0.24%	0.06%	4.14%	0.38%

双利债券C

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
过去三个月	3.78%	0.44%	-0.24%	0.06%	4.02%	0.38%

3.2.2 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



注:1、自2014年1月28日起,汇添富保本混合型证券投资基金转型为汇添富双利债券型证券投资基金,本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2014年1月28日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴江宏	汇添富可转换债券基金、汇添富盈安保本混合基金、汇添富盈稳保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富鑫利定开债、汇添富鑫利定开债、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富鑫利定开债、汇添富鑫利定开债、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富鑫利定开债基金、汇添富鑫利定开债基金、汇添富鑫利定开债、汇添富鑫利定开债、汇添富鑫利定开债