

深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2014 年 8 月 21 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。

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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 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.....	45
7.7 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.....	46
7.8 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.....	46
7.9 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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46

7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	53
§11 备查文件目录.....	54
11.1 备查文件目录.....	54
11.2 存放地点.....	54
11.3 查阅方式.....	54

§ 2 基金简介

2.1 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
基金简称	汇添富深证 300ETF
场内简称	深 300ETF
基金主代码	159912
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 16 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	103,948,991.00 份
基金合同存续期	不定期
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

2.2 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	赵会军
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288	北京市西城区复兴门内大街 55

	号 6 栋 538 室	号
办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	林利军	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,006,559.43
本期利润	-4,099,464.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0374
本期加权平均净值利润率	-4.32%
本期基金份额净值增长率	-3.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-13,828,637.39
期末可供分配基金份额利润	-0.1330
期末基金资产净值	90,120,353.61
期末基金份额净值	0.8670
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-13.30%

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、上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（例如：基金的申购赎回费等），计

入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

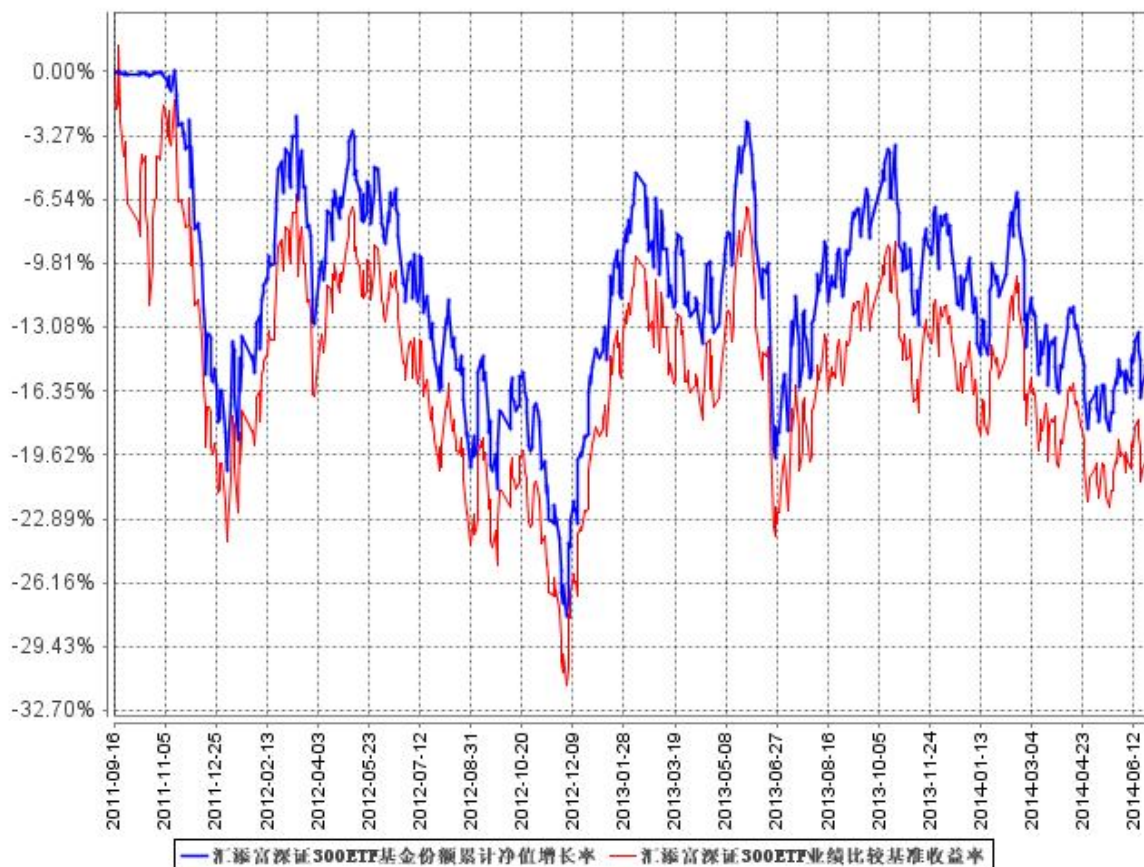
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.36%	0.96%	2.01%	0.97%	0.35%	-0.01%
过去三个月	3.70%	0.96%	2.97%	0.97%	0.73%	-0.01%
过去六个月	-3.63%	1.16%	-4.07%	1.17%	0.44%	-0.01%
过去一年	6.33%	1.23%	6.06%	1.23%	0.27%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	-13.30%	1.32%	-17.83%	1.40%	4.53%	-0.08%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 9 月 16 日，至本报告期末未满三年。

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

汇添富深证300ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011年9月16日）起3个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5号文批准，于2005年2月3日正式成立，注册资本金为1亿元人民币。截止到2014年6月30日，公司管理证券投资基金规模约981.54亿元，有效客户数约290万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理47只开放式证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长股票型证券投资基金、

汇添富成长焦点股票型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富香港优势股票型证券投资基金、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富理财 28 天债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金、汇添富消费行业股票型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽 30 股票型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富互利分级债券型证券投资基金、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富新收益债券型证券投资基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
汪洋	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	2013 年 11 月 7 日	-	5 年	国籍：中国。学历：金融工程及计算机科学双硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾

	<p>300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理。</p>			<p>任华泰联合证券有限责任公司金融工程高级研究员，华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理助理。2013 年 5 月 6 日加入汇添富基金管理股份有限公司，从事指数及 ETF 产品的投资、研究工作，2013 年 9 月 13 日至今任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 基金的基金经理，2013 年 11 月 7 日至今任汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 基金联接基</p>
--	--	--	--	--

					金的基金经理。
赖中立	汇添富上证综合指数、汇添富深证 300ETF、汇添富深证 300ETF 联接基金的基金经理助理，汇添富黄金及贵金属证券投资基金 (LOF) 的基金经理，汇添富恒生指数分级 (QDII) 基金的基金经理。	2012 年 2 月 15 日	-	7 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任金融工程部分析师。2012 年 2 月 15 日至今任汇添富上证综合指数基金、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助理，2012 年 11 月 1 日至今任

					汇添富黄金及贵金属证券投资基金(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。
--	--	--	--	--	--

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 管理人对报告期内本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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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, 形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合, 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

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》，公司制定了同日反向交易控制的规则，同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易分析。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 4 次，其中 3 次是由于对冲专户采取指数化策略投资导致，1 次是由于投资流动性的需求导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，经济复苏仍面临较大不确定性，房地产投资持续下滑仍是影响经济好转的主要阻碍，作为应对手段，“微刺激”政策持续出台，决策层守住 7.5%增长目标决心明确，央行、银监会等中央部委相继扩大了“定向宽松”的覆盖范围，部分地方政府也出台了稳增长措施。受此推动，PMI 数据有所改善，升至荣枯线上，显示实体经济的温和好转，出口复苏和基建投资部分弥补了房地产投资的疲弱。资金面上，二季度货币政策和信贷条件仍相对宽松，但 IPO 重启对流动性仍有较大的影响。多空交织，上半年市场处于整体震荡收敛状态，但不乏主题性投资机会。

本基金在报告期内遵循了 ETF 基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性，股票投资仓位在考察期内始终保持在 98%~100%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 ETF 平稳运作管理的目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内深证 300 指数下跌-4.07%，本基金在报告期内累计收益率为-3.63%，收益率超越业绩比较基准 0.44%。收益率的差异因素主要来源于期间成份股分红、日常申购赎回等因素。本基金日均跟踪误差为 0.0129%，这一跟踪误差水平远低于合同约定上限，在报告期达到了投资目标。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们相信随着更多的“微刺激”政策出台，经济复苏势头将进一步增强。需要注意的是，虽然短期内实体经济企稳复苏，但房地产活动持续下行的负面影响可能会在今年末至

明年逐渐加剧。届时这一影响可能再度拖累经济增长，迫使决策层出台更多的稳增长措施。尽管如此，市场情绪在近期的反弹行情中已经得到了恢复，在政策托底的大前提下不宜对市场过分看空。从资金面角度来看，银监会调整商业银行存贷比已经展现一贯的定向宽松导向，整体市场的流动性水平或将在此导向下有所改善，但全面宽松的货币政策概率很低，整体流动性大概率处于中性偏松的格局。外围市场方面，就业、消费、生产等方面的经济数据确认美国经济的全面复苏，而欧洲央行的激进宽松或将推高资产价格，整体来看，决定 A 股市场的依然是国内经济基本面。

目前市场整体估值较低，已经反应了较为悲观的预期，机构对周期性板块的配置比例很低，继续下跌的空间小。随着近期基本面的改善及市场情绪的好转，权益类资产的配置价值将逐渐提高。深证 300 指数作为深圳市场的标杆指数之一很可能会有较好的表现。

作为被动投资的交易所上市指数型基金，汇添富深证 300ETF 将严格遵守基金合同，继续坚持既定的指数化投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。我们非常期望汇添富深证 300ETF 能继续与投资者一起分享中国经济的美好未来。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、产品创新部、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例依据“使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的”的原则确定。

本基金本报告期内未进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理有限公司编制和披露的汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：深证 300 交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	953,315.30	1,281,647.05
结算备付金		4,456.27	9,453.82
存出保证金		1,017.48	798.94
交易性金融资产	6.4.7.2	89,173,347.02	126,945,563.44
其中: 股票投资		89,173,347.02	126,945,563.44
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		338,179.99	165,069.87
应收利息	6.4.7.5	176.93	164.71
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		90,470,492.99	128,402,697.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		36,612.06	54,792.53
应付托管费		7,322.39	10,958.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	13,887.96	18,757.39
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	292,316.97	245,000.00
负债合计		350,139.38	329,508.41
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	103,948,991.00	142,348,991.00
未分配利润	6.4.7.10	-13,828,637.39	-14,275,801.58
所有者权益合计		90,120,353.61	128,073,189.42

负债和所有者权益总计		90,470,492.99	128,402,697.83
------------	--	---------------	----------------

注：1、报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8670 元，基金份额总额 103,948,991.00 份。

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：深证 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		-3,511,546.99	-4,225,538.90
1.利息收入		3,940.02	5,917.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,940.02	5,907.39
债券利息收入		-	10.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-429,388.75	331,174.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,306,949.96	-945,906.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	13,650.67
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	877,561.21	1,263,430.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,092,905.30	-4,585,353.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	6,807.04	22,722.44
减：二、费用		587,917.74	968,457.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	235,589.64	501,435.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	47,117.91	100,287.07
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	30,035.92	54,139.47
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	275,174.27	312,596.19
三、利润总额（亏损总额以“-”		-4,099,464.73	-5,193,996.87

号填列)			
------	--	--	--

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：深证 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	142,348,991.00	-14,275,801.58	128,073,189.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,099,464.73	-4,099,464.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-38,400,000.00	4,546,628.92	-33,853,371.08
其中：1. 基金申购款	25,600,000.00	-3,498,080.99	22,101,919.01
2. 基金赎回款	-64,000,000.00	8,044,709.91	-55,955,290.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	103,948,991.00	-13,828,637.39	90,120,353.61
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	251,148,991.00	-35,649,194.63	215,499,796.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,193,996.87	-5,193,996.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-46,400,000.00	3,048,958.46	-43,351,041.54

其中：1. 基金申购款	36,800,000.00	-3,851,243.32	32,948,756.68
2. 基金赎回款	-83,200,000.00	6,900,201.78	-76,299,798.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	204,748,991.00	-37,794,233.04	166,954,757.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>林利军</u>	<u>陈灿辉</u>	<u>王小练</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

深证 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]886 号文《关于核准汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开发行募集，基金合同于 2011 年 9 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 521,548,991.00 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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。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%。本基金业绩比较基准为：深证 300 指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、

《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.4.1 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.5 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	953,315.30
定期存款	-
其他存款	-
合计：	953,315.30

注：本基金本期末未投资于定期存款。

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	89,674,939.81	89,173,347.02	-501,592.79
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		89,674,939.81	89,173,347.02	-501,592.79

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	174.52
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1.96
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.45
合计	176.93

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	13,887.96
银行间市场应付交易费用	-
合计	13,887.96

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	193,396.69
指数使用费	81,682.08
应付替代款	4,216.10
可退替代款	13,022.10
合计	292,316.97

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	142,348,991.00	142,348,991.00
本期申购	25,600,000.00	25,600,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-64,000,000.00	-64,000,000.00
本期末	103,948,991.00	103,948,991.00

注：申购含红利再投份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-14,287,484.67	11,683.09	-14,275,801.58
本期利润	-1,006,559.43	-3,092,905.30	-4,099,464.73
本期基金份额交易产生的变动数	3,870,407.11	676,221.81	4,546,628.92
其中：基金申购款	-2,672,874.79	-825,206.20	-3,498,080.99
基金赎回款	6,543,281.90	1,501,428.01	8,044,709.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,423,636.99	-2,405,000.40	-13,828,637.39

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,649.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	285.08
其他	5.74
合计	3,940.02

注：“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-604,686.99
股票投资收益——赎回差价收入	-702,262.97
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,306,949.96

6.4.6.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	9,720,165.31
减：卖出股票成本总额	10,324,852.30
买卖股票差价收入	-604,686.99

6.4.6.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	55,955,290.09
减：现金支付赎回款总额	251,649.09
减：赎回股票成本总额	56,405,903.97

赎回差价收入	-702,262.97
--------	-------------

6.4.6.13 债券投资收益

注：本基金本期末未投资债券。

6.4.6.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本期末未投资资产支持证券。

6.4.6.14 贵金属投资收益

注：本基金本期末未投资贵金属。

6.4.6.15 衍生工具收益

注：本基金本期末未投资衍生工具。

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	877,561.21
基金投资产生的股利收益	-
合计	877,561.21

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,092,905.30
——股票投资	-3,092,905.30
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-3,092,905.30

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	6,807.04
合计	6,807.04

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	30,035.92
银行间市场交易费用	-
合计	30,035.92

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	138,848.72
上市年费	29,752.78
银行划款费用	95.50
指数使用费	81,682.08
合计	275,174.27

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控集团有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富资本管理有限公司	基金管理人施加重大影响的联营企业

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
东方证券股份有限公司	20,034,546.61	98.60%	32,609,486.26	89.88%

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
东方证券股份有限公司	-	-	64,668.00	100.00%

6.4.9.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东方证券股份 有限公司	17,728.74	98.60%	13,636.70	98.19%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东方证券股份 有限公司	28,856.30	89.88%	14,118.88	81.29%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	235,589.64	501,435.24
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 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。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付	47,117.91	100,287.07

的托管费		
------	--	--

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。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

基金托管费每日计算，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 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、公休假等，支付日期顺延。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人在本报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	953,315.30	3,649.20	2,347,045.21	5,511.99

注：由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入包含了关联方保管的银行存款期末余额、除了最低备付金以外的结算备付金期末余额及当期产生的利息收入。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10 利润分配情况

6.4.10.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.11 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000562	宏源证券	2013年10月31日	重大资产重组停牌	8.22	2014年7月28日	8.93	67,414	487,613.46	554,143.08	-
000009	中国宝安	2014年5月28日	重大事项停牌	10.21	2014年8月15日	9.33	42,499	462,922.24	433,914.79	-
002570	贝因美	2014年6月19日	重大事项停牌	14.36	-	-	24,732	301,040.57	355,151.52	-
002252	上海莱士	2014年6月13日	重大资产重组停牌	63.30	-	-	5,023	133,992.29	317,955.90	-
000960	锡业股份	2014年5月6日	重大事项停牌	12.44	2014年8月5日	13.68	20,086	411,723.48	249,869.84	-
002340	格林美	2014年6月26日	重大事项停牌	11.19	2014年7月24日	11.77	21,247	210,111.56	237,753.93	-
000878	云南铜业	2014年4月17日	重大事项停牌	7.61	2014年7月17日	7.50	29,237	446,720.72	222,493.57	-
300088	长信科技	2014年3月13日	重大事项停牌	19.49	2014年7月1日	18.00	9,846	156,210.97	191,898.54	-
000762	西藏矿业	2014年4月29日	重大资产重组停牌	10.54	2014年7月28日	11.59	16,174	234,742.98	170,473.96	-
000612	焦作万方	2014年4月3日	重大资产重组停牌	6.08	2014年8月18日	6.69	23,421	155,243.26	142,399.68	-

002167	东方锆业	2014年 1月3 日	重大 资产 重组 停牌	11.39	2014年 7月1 日	11.10	12,236	192,238.12	139,368.04	-
000807	云铝股份	2014年 5月1 日	重大 事项 停牌	3.25	2014年 7月28 日	3.58	32,055	174,135.07	104,178.75	-
002151	北斗星通	2014年 5月19 日	重大 资产 重组 停牌	24.80	2014年 8月15 日	27.28	4,191	114,842.51	103,936.80	-

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、存出保证金及结算备付金等。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	953,315.30	-	-	-	-	-	953,315.30
结算备付金	4,456.27	-	-	-	-	-	4,456.27
存出保证金	1,017.48	-	-	-	-	-	1,017.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	89,173,347.02	89,173,347.02
应收证券清算款	-	-	-	-	-	338,179.99	338,179.99
应收利息	-	-	-	-	-	176.93	176.93
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	958,789.05	-	-	-	-	89,511,703.94	90,470,492.99
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	36,612.06	36,612.06
应付托管费	-	-	-	-	-	7,322.39	7,322.39
应付交易费用	-	-	-	-	-	13,887.96	13,887.96

其他负债	-	-	-	-	-	292,316.97	292,316.97
负债总计	-	-	-	-	-	350,139.38	350,139.38
利率敏感度缺口	958,789.05	-	-	-	-	89,161,564.56	90,120,353.61
上年度末 2013年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,281,647.05	-	-	-	-	-	1,281,647.05
结算备付金	9,453.82	-	-	-	-	-	9,453.82
存出保证金	798.94	-	-	-	-	-	798.94
交易性金融资产	-	-	-	-	-	126,945,563.44	126,945,563.44
应收证券清算款	-	-	-	-	-	165,069.87	165,069.87
应收利息	-	-	-	-	-	164.71	164.71
资产总计	1,291,899.81	-	-	-	-	127,110,798.02	128,402,697.83
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	54,792.53	54,792.53
应付托管费	-	-	-	-	-	10,958.49	10,958.49
应付交易费用	-	-	-	-	-	18,757.39	18,757.39
其他负债	-	-	-	-	-	245,000.00	245,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	329,508.41	329,508.41
利率敏感度缺口	1,291,899.81	-	-	-	-	-126,781,289.61	128,073,189.42

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期期末计息资产仅包括银行存款，且以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本期期末未持有其他资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

6.4.12.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	89,173,347.02	98.95	126,945,563.44	99.12
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	89,173,347.02	98.95	126,945,563.44	99.12

注：本基金投资组合中股票投资比例范围为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。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表所示。

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与所投资证券的贝塔系数紧密相关；		
	对于上市时间不足一年的股票，使用申银万国行业指数替代股票价格计算其贝塔系数；		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	深证 300 指数上涨 5%	4,502,838.16	6,318,674.57
	深证 300 指数下跌 5%	-4,502,838.16	-6,318,674.57

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	89,173,347.02	98.57
	其中：股票	89,173,347.02	98.57
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	957,771.57	1.06
7	其他各项资产	339,374.40	0.38
8	合计	90,470,492.99	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	1,378,288.47	1.53
B	采矿业	2,215,455.95	2.46
C	制造业	53,435,290.82	59.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,366,190.21	1.52
E	建筑业	1,470,065.16	1.63
F	批发和零售业	3,506,189.51	3.89
G	交通运输、仓储和邮政业	423,186.30	0.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,217,905.53	8.01
J	金融业	6,088,719.66	6.76
K	房地产业	5,429,365.16	6.02
L	租赁和商务服务业	2,080,184.83	2.31
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,868,628.69	2.07

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	198,979.50	0.22
R	文化、体育和娱乐业	1,965,877.46	2.18
S	综合	529,019.77	0.59
	合计	89,173,347.02	98.95

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

7.3 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

7.3.1 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	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科 A	341,198	2,821,707.46	3.13
2	000651	格力电器	90,650	2,669,642.50	2.96
3	000001	平安银行	199,279	1,974,854.89	2.19
4	000333	美的集团	72,898	1,408,389.36	1.56
5	000858	五粮液	70,834	1,270,053.62	1.41
6	000776	广发证券	116,317	1,139,906.60	1.26
7	002024	苏宁云商	162,797	1,067,948.32	1.19
8	000625	长安汽车	80,340	988,985.40	1.10
9	000063	中兴通讯	74,034	971,326.08	1.08
10	000895	双汇发展	24,986	894,248.94	0.99
11	000538	云南白药	16,276	849,607.20	0.94
12	000725	京东方 A	377,524	819,227.08	0.91
13	002415	海康威视	48,066	814,238.04	0.90
14	002475	立讯精密	10,300	773,624.00	0.86
15	300027	华谊兄弟	31,432	751,853.44	0.83
16	002241	歌尔声学	28,089	748,852.74	0.83
17	000157	中联重科	166,791	738,884.13	0.82
18	000338	潍柴动力	41,256	733,944.24	0.81
19	002594	比亚迪	15,253	724,364.97	0.80
20	000423	东阿阿胶	21,346	711,248.72	0.79
21	000100	TCL 集团	304,935	695,251.80	0.77
22	000783	长江证券	68,650	659,040.00	0.73

23	300070	碧水源	22,142	647,653.50	0.72
24	002450	康得新	28,467	647,624.25	0.72
25	002230	科大讯飞	23,961	637,362.60	0.71
26	300104	乐视网	14,276	626,716.40	0.70
27	000069	华侨城 A	133,047	623,990.43	0.69
28	002353	杰瑞股份	15,354	617,998.50	0.69
29	002065	东华软件	30,454	612,734.48	0.68
30	000581	威孚高科	22,452	605,530.44	0.67
31	002202	金风科技	62,815	596,114.35	0.66
32	002236	大华股份	21,625	582,793.75	0.65
33	300024	机器人	19,328	568,243.20	0.63
34	000562	宏源证券	67,414	554,143.08	0.61
35	000793	华闻传媒	46,403	545,235.25	0.61
36	002008	大族激光	31,127	539,742.18	0.60
37	000503	海虹控股	27,626	538,707.00	0.60
38	002304	洋河股份	10,536	534,702.00	0.59
39	002456	欧菲光	24,461	524,199.23	0.58
40	300058	蓝色光标	19,631	521,006.74	0.58
41	300017	网宿科技	8,064	514,483.20	0.57
42	000400	许继电气	25,251	506,282.55	0.56
43	002038	双鹭药业	10,811	481,846.27	0.53
44	002081	金螳螂	33,974	481,071.84	0.53
45	000768	中航飞机	45,192	475,871.76	0.53
46	000831	五矿稀土	22,676	475,742.48	0.53
47	300124	汇川科技	15,198	474,177.60	0.53
48	002465	海格通信	29,600	471,528.00	0.52
49	000963	华东医药	8,625	465,750.00	0.52
50	000039	中集集团	33,948	456,940.08	0.51
51	000402	金融街	83,820	456,819.00	0.51
52	000024	招商地产	43,606	454,374.52	0.50
53	000568	泸州老窖	27,704	453,791.52	0.50
54	000623	吉林敖东	28,821	447,301.92	0.50
55	000917	电广传媒	29,327	446,650.21	0.50
56	000009	中国宝安	42,499	433,914.79	0.48
57	000826	桑德环境	18,558	424,050.30	0.47
58	000970	中科三环	34,768	413,043.84	0.46
59	002190	成飞集成	6,998	412,882.00	0.46
60	300002	神州泰岳	25,840	406,980.00	0.45
61	002400	省广股份	16,500	405,570.00	0.45

62	000559	万向钱潮	39,217	403,150.76	0.45
63	002142	宁波银行	42,383	389,923.60	0.43
64	300059	东方财富	31,828	382,890.84	0.42
65	002022	科华生物	16,488	380,048.40	0.42
66	000792	盐湖股份	24,501	369,230.07	0.41
67	300003	乐普医疗	17,427	364,224.30	0.40
68	002422	科伦药业	9,048	360,562.80	0.40
69	000060	中金岭南	52,884	359,611.20	0.40
70	000728	国元证券	37,658	355,491.52	0.39
71	000661	长春高新	4,370	355,281.00	0.39
72	002570	贝因美	24,732	355,151.52	0.39
73	000998	隆平高科	12,915	354,904.20	0.39
74	000598	兴蓉投资	73,523	350,704.71	0.39
75	002385	大北农	30,318	344,412.48	0.38
76	000977	浪潮信息	9,586	337,235.48	0.37
77	000061	农产品	36,508	336,968.84	0.37
78	300315	掌趣科技	18,562	331,517.32	0.37
79	002405	四维图新	19,568	325,220.16	0.36
80	000983	西山煤电	61,051	321,738.77	0.36
81	300133	华策影视	10,057	321,321.15	0.36
82	000012	南玻 A	46,967	320,784.61	0.36
83	002252	上海莱士	5,023	317,955.90	0.35
84	002152	广电运通	18,495	315,154.80	0.35
85	002007	华兰生物	12,063	314,844.30	0.35
86	002005	德豪润达	37,598	314,695.26	0.35
87	000729	燕京啤酒	48,350	314,275.00	0.35
88	000629	攀钢钒钛	150,770	313,601.60	0.35
89	000778	新兴铸管	84,502	313,502.42	0.35
90	000413	东旭光电	41,600	312,000.00	0.35
91	000800	一汽轿车	32,481	311,817.60	0.35
92	300026	红日药业	10,462	306,526.60	0.34
93	002410	广联达	11,500	304,060.00	0.34
94	000425	徐工机械	44,165	302,530.25	0.34
95	300273	和佳股份	9,784	300,368.80	0.33
96	000839	中信国安	39,011	296,483.60	0.33
97	000709	河北钢铁	156,442	290,982.12	0.32
98	000511	烯碳新材	41,884	282,298.16	0.31
99	002250	联化科技	19,738	280,279.60	0.31
100	002292	奥飞动漫	7,598	278,846.60	0.31

101	002063	远光软件	13,618	278,488.10	0.31
102	000999	华润三九	15,093	277,560.27	0.31
103	002129	中环股份	14,529	277,068.03	0.31
104	000686	东北证券	38,273	274,417.41	0.30
105	000876	新希望	24,031	271,309.99	0.30
106	002701	奥瑞金	13,335	268,966.95	0.30
107	300251	光线传媒	12,102	268,422.36	0.30
108	002104	恒宝股份	13,501	264,619.60	0.29
109	002219	恒康医疗	11,997	263,694.06	0.29
110	002440	闰土股份	13,997	258,944.50	0.29
111	300079	数码视讯	23,446	255,561.40	0.28
112	000630	铜陵有色	28,465	255,046.40	0.28
113	000848	承德露露	12,639	251,136.93	0.28
114	000960	锡业股份	20,086	249,869.84	0.28
115	300077	国民技术	8,950	246,483.00	0.27
116	000758	中色股份	24,423	242,764.62	0.27
117	002001	新和成	19,515	241,790.85	0.27
118	002375	亚厦股份	10,691	241,188.96	0.27
119	002004	华邦颖泰	12,899	239,921.40	0.27
120	300146	汤臣倍健	9,725	239,721.25	0.27
121	002340	格林美	21,247	237,753.93	0.26
122	002344	海宁皮城	19,046	237,503.62	0.26
123	002073	软控股份	24,753	236,886.21	0.26
124	002048	宁波华翔	15,828	235,837.20	0.26
125	000750	国海证券	24,925	235,541.25	0.26
126	000997	新大陆	13,532	234,915.52	0.26
127	300212	易华录	7,500	234,900.00	0.26
128	000825	太钢不锈	86,537	229,323.05	0.25
129	002030	达安基因	11,785	229,218.25	0.25
130	002191	劲嘉股份	16,975	225,767.50	0.25
131	002092	中泰化学	36,490	225,508.20	0.25
132	300072	三聚环保	11,274	225,367.26	0.25
133	000988	华工科技	23,910	224,514.90	0.25
134	000878	云南铜业	29,237	222,493.57	0.25
135	002153	石基信息	4,311	221,154.30	0.25
136	002106	莱宝高科	19,498	220,327.40	0.24
137	000541	佛山照明	21,897	218,094.12	0.24
138	002146	荣盛发展	22,834	216,237.98	0.24
139	002500	山西证券	33,282	216,000.18	0.24

140	002310	东方园林	12,986	214,398.86	0.24
141	002049	同方国芯	8,949	212,538.75	0.24
142	000939	凯迪电力	28,538	211,181.20	0.23
143	002294	信立泰	6,999	210,109.98	0.23
144	300257	开山股份	6,583	208,615.27	0.23
145	000028	国药一致	5,217	208,419.15	0.23
146	002185	华天科技	18,578	207,702.04	0.23
147	002155	辰州矿业	27,698	207,181.04	0.23
148	002223	鱼跃医疗	8,526	206,755.50	0.23
149	000690	宝新能源	50,111	204,452.88	0.23
150	000829	天音控股	24,045	203,420.70	0.23
151	000046	泛海控股	45,259	202,307.73	0.22
152	000550	江铃汽车	6,934	200,947.32	0.22
153	000851	高鸿股份	18,880	200,694.40	0.22
154	002051	中工国际	12,331	199,762.20	0.22
155	000969	安泰科技	21,641	199,097.20	0.22
156	300015	爱尔眼科	8,175	198,979.50	0.22
157	300274	阳光能源	11,900	196,469.00	0.22
158	002273	水晶光电	10,538	192,845.40	0.21
159	300088	长信科技	9,846	191,898.54	0.21
160	000887	中鼎股份	19,808	191,345.28	0.21
161	000735	罗牛山	31,213	191,023.56	0.21
162	300157	恒泰艾普	14,761	191,007.34	0.21
163	000049	德赛电池	4,737	190,285.29	0.21
164	000592	平潭发展	22,640	189,723.20	0.21
165	002299	圣农发展	16,367	189,693.53	0.21
166	000513	丽珠集团	4,005	189,156.15	0.21
167	300228	富瑞特装	3,654	186,938.64	0.21
168	000788	北大医药	12,167	184,695.06	0.20
169	002429	兆驰股份	23,712	183,530.88	0.20
170	300039	上海凯宝	14,609	183,196.86	0.20
171	002183	怡亚通	23,521	181,817.33	0.20
172	002396	星网锐捷	6,473	181,179.27	0.20
173	300090	盛运股份	11,500	181,125.00	0.20
174	000528	柳工	31,079	180,879.78	0.20
175	002428	云南锗业	14,837	179,972.81	0.20
176	000566	海南海药	16,390	178,323.20	0.20
177	002052	同洲电子	19,716	177,246.84	0.20
178	002368	太极股份	5,208	174,415.92	0.19

179	002673	西部证券	16,097	173,847.60	0.19
180	002573	国电清新	9,837	172,934.46	0.19
181	000027	深圳能源	30,498	171,398.76	0.19
182	000762	西藏矿业	16,174	170,473.96	0.19
183	002050	三花股份	15,605	169,470.30	0.19
184	300052	中青宝	5,928	166,102.56	0.18
185	000883	湖北能源	31,400	165,478.00	0.18
186	000937	冀中能源	28,360	165,338.80	0.18
187	002312	三泰电子	8,100	164,997.00	0.18
188	002138	顺络电子	7,805	162,812.30	0.18
189	002161	远望谷	20,999	161,692.30	0.18
190	000898	鞍钢股份	52,800	161,040.00	0.18
191	002311	海大集团	14,572	160,437.72	0.18
192	002041	登海种业	5,740	159,801.60	0.18
193	000786	北新建材	11,629	159,549.88	0.18
194	000652	泰达股份	41,200	159,444.00	0.18
195	000422	湖北宜化	31,705	158,842.05	0.18
196	000726	鲁泰 A	17,945	157,736.55	0.18
197	000078	海王生物	21,236	157,358.76	0.17
198	002317	众生药业	7,874	157,243.78	0.17
199	002399	海普瑞	8,301	155,062.68	0.17
200	000616	亿城投资	48,624	154,624.32	0.17
201	000816	江淮动力	35,529	153,485.28	0.17
202	000488	晨鸣纸业	34,503	150,433.08	0.17
203	002056	横店东磁	7,681	149,472.26	0.17
204	002148	北纬通信	6,837	149,046.60	0.17
205	002467	二六三	12,824	147,860.72	0.16
206	000982	中银绒业	20,356	147,581.00	0.16
207	000877	天山股份	24,116	147,348.76	0.16
208	000587	金叶珠宝	14,184	147,229.92	0.16
209	002069	獐子岛	10,510	146,929.80	0.16
210	000401	冀东水泥	18,071	146,917.23	0.16
211	002029	七匹狼	18,148	146,635.84	0.16
212	002477	雏鹰农牧	15,538	146,212.58	0.16
213	002181	粤传媒	9,200	145,360.00	0.16
214	000830	鲁西化工	41,285	145,323.20	0.16
215	002028	思源电气	15,455	145,277.00	0.16
216	000926	福星股份	22,261	145,141.72	0.16
217	000938	紫光股份	5,656	144,341.12	0.16

218	000671	阳光城	16,382	143,997.78	0.16
219	002653	海思科	7,496	143,923.20	0.16
220	000933	神火股份	41,515	143,641.90	0.16
221	000540	中天城投	28,044	143,024.40	0.16
222	000516	开元投资	21,200	142,464.00	0.16
223	000612	焦作万方	23,421	142,399.68	0.16
224	002064	华峰氨纶	16,561	141,762.16	0.16
225	002176	江特电机	11,259	141,075.27	0.16
226	000415	渤海租赁	18,344	140,881.92	0.16
227	000718	苏宁环球	31,193	140,680.43	0.16
228	000050	深天马 A	11,215	140,187.50	0.16
229	000021	长城开发	23,636	139,452.40	0.15
230	002167	东方锆业	12,236	139,368.04	0.15
231	000823	超声电子	11,416	138,476.08	0.15
232	002168	深圳惠程	18,862	138,447.08	0.15
233	002262	恩华药业	6,192	137,524.32	0.15
234	000088	盐田港	26,922	136,763.76	0.15
235	000975	银泰资源	17,142	136,621.74	0.15
236	000539	粤电力 A	28,830	136,365.90	0.15
237	000731	四川美丰	20,761	135,984.55	0.15
238	000572	海马汽车	36,701	135,793.70	0.15
239	000543	皖能电力	20,453	134,989.80	0.15
240	002277	友阿股份	14,068	133,646.00	0.15
241	000860	顺鑫农业	9,503	133,422.12	0.15
242	001696	宗申动力	29,003	131,383.59	0.15
243	002011	盾安环境	16,441	130,377.13	0.14
244	000900	现代投资	28,142	129,734.62	0.14
245	002237	恒邦股份	10,048	128,312.96	0.14
246	000685	中山公用	12,338	125,477.46	0.14
247	002431	棕榈园林	6,969	124,048.20	0.14
248	000031	中粮地产	38,028	123,971.28	0.14
249	002313	日海通讯	9,983	123,689.37	0.14
250	000006	深振业 A	26,960	123,476.80	0.14
251	002079	苏州固锝	16,863	122,088.12	0.14
252	002140	东华科技	7,251	122,034.33	0.14
253	002025	航天电器	7,634	119,777.46	0.13
254	000525	红太阳	8,500	119,085.00	0.13
255	300074	华平股份	7,800	118,950.00	0.13
256	002123	荣信股份	15,473	118,677.91	0.13

257	000979	中弘股份	39,877	118,434.69	0.13
258	002229	鸿博股份	6,500	116,155.00	0.13
259	000563	陕国投 A	17,971	115,553.53	0.13
260	002091	江苏国泰	7,456	114,151.36	0.13
261	002408	齐翔腾达	7,970	111,101.80	0.12
262	000062	深圳华强	7,093	111,076.38	0.12
263	000996	中国中期	7,792	110,880.16	0.12
264	000650	仁和药业	23,331	110,822.25	0.12
265	000869	张裕 A	4,588	110,616.68	0.12
266	002242	九阳股份	11,088	109,549.44	0.12
267	002414	高德红外	6,000	109,140.00	0.12
268	000417	合肥百货	20,917	108,140.89	0.12
269	300191	潜能恒信	4,200	108,108.00	0.12
270	000501	鄂武商 A	9,112	106,610.40	0.12
271	000089	深圳机场	27,814	104,858.78	0.12
272	000807	云铝股份	32,055	104,178.75	0.12
273	002151	北斗星通	4,191	103,936.80	0.12
274	002646	青青稞酒	6,691	103,643.59	0.12
275	002603	以岭药业	3,500	102,970.00	0.11
276	000901	航天科技	6,257	101,050.55	0.11
277	000537	广宇发展	17,247	98,825.31	0.11
278	002556	辉隆股份	11,444	96,701.80	0.11
279	002308	威创股份	14,330	95,724.40	0.11
280	002577	雷柏科技	3,600	95,328.00	0.11
281	000551	创元科技	11,202	95,104.98	0.11
282	002055	得润电子	9,735	93,553.35	0.10
283	002476	宝莫股份	11,388	93,381.60	0.10
284	002416	爱施德	6,265	93,035.25	0.10
285	000989	九芝堂	7,542	92,012.40	0.10
286	000596	古井贡酒	4,766	90,887.62	0.10
287	002275	桂林三金	5,921	89,880.78	0.10
288	000961	中南建设	13,409	87,560.77	0.10
289	002244	滨江集团	15,122	85,741.74	0.10
290	002128	露天煤业	12,784	83,096.00	0.09
291	002203	海亮股份	7,299	80,361.99	0.09
292	000156	华数传媒	2,814	79,045.26	0.09
293	002267	陕天然气	8,497	77,322.70	0.09
294	300152	燃控科技	6,356	73,284.68	0.08
295	002269	美邦服饰	8,638	71,781.78	0.08

296	002095	生意宝	3,190	68,266.00	0.08
297	000552	靖远煤电	7,924	64,342.88	0.07
298	000022	深赤湾 A	3,993	51,829.14	0.06

7.3.2 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进行积极投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002465	海格通信	454,656.00	0.35
2	002400	省广股份	401,578.00	0.31
3	002475	立讯精密	318,175.00	0.25
4	300315	掌趣科技	317,485.49	0.25
5	000413	东旭光电	311,759.80	0.24
6	002410	广联达	289,223.00	0.23
7	300212	易华录	235,863.00	0.18
8	002573	国电清新	222,510.53	0.17
9	002049	同方国芯	213,713.11	0.17
10	300257	开山股份	211,703.28	0.17
11	000851	高鸿股份	197,815.00	0.15
12	300274	阳光电源	194,881.00	0.15
13	300157	恒泰艾普	194,024.76	0.15
14	300090	盛运股份	181,700.00	0.14
15	300039	上海凯宝	178,630.57	0.14
16	000883	湖北能源	167,362.00	0.13
17	002312	三泰电子	165,641.70	0.13
18	000898	鞍钢股份	162,096.00	0.13
19	000625	长安汽车	156,743.50	0.12
20	000793	华闻传媒	149,735.00	0.12

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。

7.4.2 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	000538	云南白药	272,391.63	0.21
2	000651	格力电器	196,508.15	0.15
3	000002	万科A	194,432.76	0.15
4	002353	杰瑞股份	168,266.80	0.13
5	002415	海康威视	137,134.12	0.11
6	000001	平安银行	131,634.55	0.10
7	000930	中粮生化	131,399.15	0.10
8	000090	天健集团	128,980.73	0.10
9	000667	美好集团	128,746.91	0.10
10	002254	泰和新材	119,424.34	0.09
11	000850	华茂股份	115,321.33	0.09
12	000799	酒鬼酒	113,914.32	0.09
13	002122	天马股份	111,647.84	0.09
14	002142	宁波银行	111,610.88	0.09
15	002526	山东矿机	109,181.81	0.09
16	000059	华锦股份	108,852.03	0.08
17	000752	西藏发展	107,871.56	0.08
18	300228	富瑞特装	107,827.10	0.08
19	000962	东方钨业	105,529.31	0.08
20	000790	华神集团	105,313.21	0.08

注：卖出金额按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	10,598,219.57
卖出股票收入（成交）总额	9,720,165.31

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。

7.5 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投资。

7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无国债期货持仓。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	1,017.48
2	应收证券清算款	338,179.99
3	应收股利	-

4	应收利息	176.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	339,374.40

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未进行积极投资，不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,816	57,240.63	52,657,377.00	50.66%	51,291,614.00	49.34%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
中国工商银行-汇添富深证 300 交 易型开放式指数证券投资基金联接 基金	44,485,043.00	42.80%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
----	-------	---------	--------------

1	中国工商银行-汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	44,485,043.00	42.80%
2	翟秀英	5,000,208.00	4.81%
3	上海市中小学幼儿教师奖励基金会	3,000,875.00	2.89%
4	李华	2,000,277.00	1.92%
5	中国银河证券股份有限公司	1,886,944.00	1.82%
6	曾海燕	1,503,700.00	1.45%
7	杨金星	1,000,125.00	0.96%
8	北京中兴通轨道技术有限公司	990,000.00	0.95%
9	王勤华	985,100.00	0.95%
10	北京宝罗服装服饰有限责任公司	900,037.00	0.87%
11	苗桂玲	700,000.00	0.67%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年9月16日）基金份额总额	521,548,991.00
本报告期期初基金份额总额	142,348,991.00
本报告期基金总申购份额	25,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	64,000,000.00
本报告期期末基金份额总额	103,948,991.00

注：申购含红利再投份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘汤从珊女士担任汇添富理财 30 天债券型证券投资基金的基金经理。同时，曾刚先生不再担任该基金的基金经理。

2、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘汤从珊女士担任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理。同时，曾刚先生不再担任该基金的基金经理。

3、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘陆文磊先生担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理。同时，陈加荣先生不再担任该基金的基金经理。

4、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘何旻先生担任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。

5、《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》于 2014 年 3 月 6 日正式生效，赖中立先生任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2014 年 3 月 28 日公告，增聘雷鸣先生担任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理，与齐东超先生共同管理该基金。

7、基金管理人 2014 年 4 月 10 日公告，汇添富成长焦点股票型证券投资基金由雷鸣先生单独管理，齐东超先生不再管理该基金。

8、基金管理人 2014 年 4 月 10 日公告，增聘朱晓亮先生担任汇添富民营活力股票型证券投资基金的基金经理。同时，齐东超先生不再担任该基金的基金经理。

9、基金管理人 2014 年 4 月 10 日公告，增聘顾耀强先生担任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，与韩贤旺先生、叶从飞先生、朱晓亮先生共同管理该基金。

10、《汇添富和聚宝货币市场基金基金合同》于 2014 年 5 月 28 日正式生效，汤从珊女士任该基金的基金经理。

11、本报告期内，因基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	20,034,546.61	98.60%	17,728.74	98.60%	-
国泰君安证券	1	154,979.18	0.76%	137.21	0.76%	-
国金证券	2	96,636.60	0.48%	85.52	0.48%	-
中信证券	1	32,222.49	0.16%	28.53	0.16%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-

江海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

国海证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

此 38 个交易单元与汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、中证主要消费交易

型开放式指数证券投资基金、中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金共用。本报告期内新增 1 家证券公司的 2 个交易单元：民族证券（上交所交易单元和深交所交易单元），退租 1 家证券公司的 1 个交易单元：湘财证券（上交所交易单元）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于调整现金宝快速取现业务规则的公告	管理人网站	2014 年 1 月 1 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2013 年年度资产净值的公告	管理人网站	2014 年 1 月 2 日
3	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2013 年第 4 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 1 月 20 日
4	汇添富现金宝理财服务澄清公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 2 月 25 日
5	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2013 年年度报告	管理人网站	2014 年 3 月 26 日
6	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2013 年年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 3 月 26 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于客服中心变更办公地址的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 4 月 10 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于变更直销中心银行账户信息的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 4 月 21 日
9	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 4 月 22 日
10	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 (2014 年第 1 号)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 4 月 29 日
11	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2014 年第 1 号)	管理人网站	2014 年 4 月 29 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关	中国证券报, 上海证	2014 年 6 月 10 日

	于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	券报, 证券时报, 管理人网站	
--	------------------------------------	-----------------	--

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准深证 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《深证 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《深证 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内深证 300 交易型开放式指数证券投资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。

11.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理股份有限公司

11.3 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
2014 年 8 月 25 日