

深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 27 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 2016 年 8 月 25 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 2016 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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末上市基金前十名持有人	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件.....	55
§11 备查文件目录	56
11.1 备查文件目录	56
11.2 存放地点	56
11.3 查阅方式.....	56

§ 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	57,548,991.00 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	李鹏	洪渊
	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	李文	易会满

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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-5,126,923.32
本期利润	-13,735,145.91
加权平均基金份额本期利润	-0.2411
本期加权平均净值利润率	-19.15%
本期基金份额净值增长率	-16.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	17,116,789.29
期末可供分配基金份额利润	0.2974
期末基金资产净值	74,665,780.29
期末基金份额净值	1.2974
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	29.74%

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

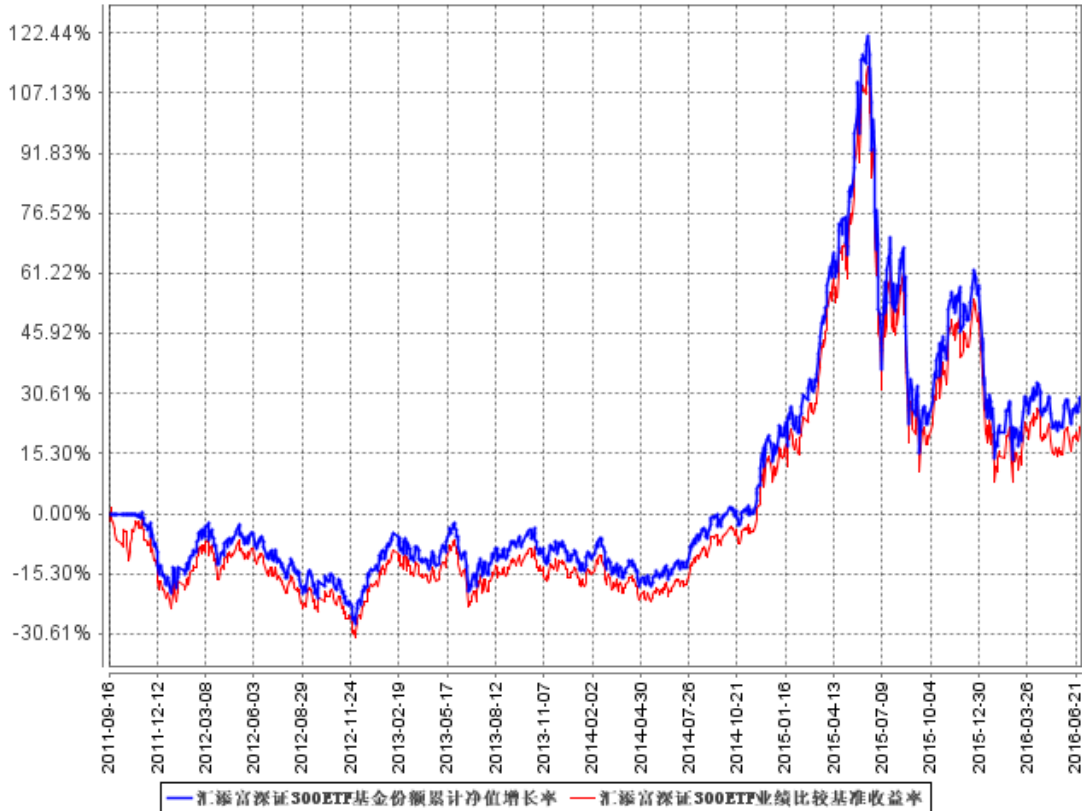
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.48%	1.36%	2.41%	1.39%	0.07%	-0.03%
过去三个月	0.15%	1.41%	-0.43%	1.45%	0.58%	-0.04%
过去六个月	-16.50%	2.25%	-17.44%	2.32%	0.94%	-0.07%
过去一年	-26.72%	2.64%	-28.14%	2.66%	1.42%	-0.02%
过去三年	59.11%	1.97%	58.18%	1.98%	0.93%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今	29.74%	1.77%	22.56%	1.81%	7.18%	-0.04%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 9 月 16 日，至本报告期末未满五年。

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，注册资本为11762.2978万元人民币。截止到2016年6月30日，公司管理证券投资基金规模约2857亿元，有效客户数约1200万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理63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、汇添富均衡增长混合型证券投资基金、汇添富成长焦点混合型证券投资基金、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、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富民营活力混合型证券投资基金、汇添富香港优势混合型证券投资基金、汇添富医药保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、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 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、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、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富优选回报混合型证券投资基金、汇添富消费行业混合型证券投资基金、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 混合型证券投资基金、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、汇添富添富通货币市场基金、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、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富成长多因子量化策略股票基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务混合型证券投资基金、汇添富国企创新增长股票型证券投资基金、汇添富民营新动力股票型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富新兴消费股票型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金、汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富盈安保本混合型证券投资基金、汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金。

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		
赖 中	汇添富黄	2015 年 1 月 6 日	-	9 年	国籍：中国，学历：北京大学

立	<p>金及贵金属基金 (LOF) 的基金经理、汇添富恒生指数分级 (QDII) 基金、汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 联接基金、汇添富香港优势精选混合基金的基金经理。</p>			<p>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 (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 日至今任汇添富香港优势混合基金的基金经理。</p>
过 蓓	<p>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 联接基金的基金经理。</p>	<p>2015 年 8 月 18 日</p>	-	<p>5 年</p> <p>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。</p>

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合规守信情况的说明

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

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 1 次，由于组合投资策略导致。经检查和分

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

2016 年上半年沪深 300 指数下跌 15.47%，全球主要股指先抑后扬出现企稳震荡行情。全球经

济表现依旧不佳，美国宽松货币政策不断延期以解决经济增长乏力和结构性失业的问题，大选落定前年内加息概率几无，在一定程度上缓解了中国资本流出的压力。同时，货币宽松到负利率阶段，对经济增长的边际作用越来越弱，对信用货币体系也带来冲击，黄金、大宗商品、房地产、债券市场受益于宽松的货币环境和动荡的政治局势，成为 2016 年上半年表现最好的投资品种。

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 95%~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-17.44%，本基金在报告期内累计收益率为-16.50%，收益率超越业绩比较基准 0.94%。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 0.0535%，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

2016 年上半年政策着力于稳增长，货币环境较为宽松；下半年货币政策继续主动放松的空间不大，而供给侧改革、扩大总需求、国企改革将成为着力点，引导货币脱虚向实，引导经济去产能、去杠杆。A 股市场趋势性机会仍需等待，但是结构性行情已经向业绩和价值投资转换，情绪面较为乐观。

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。

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。

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、固定收益部、基金营运部和稽核监察部人员组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有丰富的证券基金行业从业经验，能够胜任估值决策工作，且之间不存在任何重大利益冲突。

基金经理不介入基金日常估值业务，但可以参加估值小组会议，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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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——汇添富基金管理股份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。本报告期内，汇添富深证 300ETF 证券投资基金未进行利润分配。

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股份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 2016 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	718,194.56	1,840,816.97
结算备付金		4,702.35	1,863.04
存出保证金		456.09	4,589.96
交易性金融资产	6.4.7.2	74,294,107.75	85,294,696.35
其中：股票投资		74,285,407.75	85,281,096.35
基金投资		-	-
债券投资		8,700.00	13,600.00
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		-	74,497.91
应收利息	6.4.7.5	139.34	373.88
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		75,017,600.09	87,216,838.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 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		54,733.32	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		30,769.44	37,285.08
应付托管费		6,153.87	7,457.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	10,738.85	15,556.04
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	249,424.32	225,000.00
负债合计		351,819.80	285,298.12
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	57,548,991.00	55,948,991.00
未分配利润	6.4.7.10	17,116,789.29	30,982,548.99
所有者权益合计		74,665,780.29	86,931,539.99
负债和所有者权益总计		75,017,600.09	87,216,838.11

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2974 元，基金份额总额 57,548,991.00 份。

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-13,246,242.46	39,127,577.83
1.利息收入		3,456.45	5,309.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,449.05	5,243.66
债券利息收入		7.40	65.46
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）		-4,663,261.58	51,384,192.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,132,253.41	50,942,760.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,516.71	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	467,475.12	441,432.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,608,222.59	-12,658,991.55
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	21,785.26	397,067.64
减：二、费用		488,903.45	610,913.57

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	178,676.56	252,651.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	35,735.29	50,530.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	19,985.28	53,508.70
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	254,506.32	254,223.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,735,145.91	38,516,664.26

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	55,948,991.00	30,982,548.99	86,931,539.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,735,145.91	-13,735,145.91
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）	1,600,000.00	-130,613.79	1,469,386.21
其中：1. 基金申购款	11,200,000.00	2,462,767.31	13,662,767.31
2. 基金赎回款	-9,600,000.00	-2,593,381.10	-12,193,381.10
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）	57,548,991.00	17,116,789.29	74,665,780.29
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		

指数收益率。

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颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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[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。

6.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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[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[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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	718,194.56
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	718,194.56

注：本基金本期末未投资于定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	87,619,632.01	74,285,407.75	-13,334,224.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	8,700.00	8,700.00
	银行间市场	-	-

	合计	8,700.00	8,700.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	87,628,332.01	74,294,107.75	-13,334,224.26

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	136.60
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	0.37
应收债券利息	2.19
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	0.18
合计	139.34

注：“其他”为应收存出保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	10,738.85

银行间市场应付交易费用	-
合计	10,738.85

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	24,863.02
预提信息披露费	119,726.04
上市费	29,835.26
指数使用费	75,000.00
合计	249,424.32

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,948,991.00	55,948,991.00
本期申购	11,200,000.00	11,200,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-9,600,000.00	-9,600,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	57,548,991.00	57,548,991.00

注：申购含红利再投份额。

6.4.7.10 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	39,585,357.08	-8,602,808.09	30,982,548.99
本期利润	-5,126,923.32	-8,608,222.59	-13,735,145.91
本期基金份额交易产生的变动数	927,268.78	-1,057,882.57	-130,613.79
其中：基金申购款	7,433,599.58	-4,970,832.27	2,462,767.31
基金赎回款	-6,506,330.80	3,912,949.70	-2,593,381.10

本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,385,702.54	-18,268,913.25	17,116,789.29

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	3,249.78
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	190.91
其他	8.36
合计	3,449.05

注：“其他”为存出保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,738,845.53
股票投资收益——赎回差价收入	-3,393,407.88
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-5,132,253.41

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	6,034,465.07
减：卖出股票成本总额	7,773,310.60
买卖股票差价收入	-1,738,845.53

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
赎回基金份额对价总额	12,193,381.10

减：现金支付赎回款总额	554,187.10
减：赎回股票成本总额	15,032,601.88
赎回差价收入	-3,393,407.88

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	15,124.01
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,600.00
减：应收利息总额	7.30
买卖债券差价收入	1,516.71

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本期末未投资贵金属。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本期末未投资贵金属。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本期末未投资贵金属。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本期末未投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本期未投资衍生工具。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本期未投资衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	467,475.12
基金投资产生的股利收益	-
合计	467,475.12

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-8,608,222.59
——股票投资	-8,608,222.59
——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	-8,608,222.59

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	21,785.26
合计	21,785.26

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	19,985.28
银行间市场交易费用	-
合计	19,985.28

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	49,726.04
银行划款费用	82.00
上市年费	29,835.26
指数使用费	150,000.00
合计	254,506.32

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	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

注：1、经本公司 2016 年第二次股东大会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准，本公司的股东文汇新民联合报业集团已变更为上海上报资产管理有限公司。本公司已于 2016 年 8 月 13 日就上述股东变更事项进行公告。

2、以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	13,950,164.80	100.00%	38,048,537.34	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	15,124.01	100.00%	-	

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	12,712.83	100.00%	10,738.85	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	33,669.31	100.00%	24,987.53	100.00%
------------	-----------	---------	-----------	---------

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	178,676.56	252,651.12
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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	35,735.29	50,530.21

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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
东方证券股份有 限公司	155,240.00	0.27%	1,034,716.00	1.85%

6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	718,194.56	3,249.78	623,130.90	3,872.27

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2016年1月1日至2016年6月30日止期间获得的利息收入为人民币190.91元，2016年6月30日结算备付金余额为人民币4,702.35元。

6.4.10.6 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。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 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。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 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
000002	万科A	2015年12月18日	重大资产重组停牌	24.43	2016年7月4日	21.99	163,798	2,587,060.88	4,001,585.14	-
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项停牌	19.22	-	-	77,348	1,853,580.79	1,486,628.56	-
002065	东华软件	2015年12月21日	重大事项停牌	25.10	2016年7月4日	22.59	16,230	470,846.34	407,373.00	-
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项停牌	12.44	-	-	28,330	464,826.09	352,425.20	-
000728	国元证券	2016年6月8日	重大事项停牌	16.72	2016年7月8日	17.37	20,971	535,089.49	350,635.12	-
000718	苏宁环球	2016年1月4日	重大事项停牌	13.09	2016年7月18日	11.78	19,811	228,343.47	259,325.99	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项停牌	8.29	-	-	24,829	407,574.87	205,832.41	-
000415	渤海金控	2016年2月1日	重大资产重组停牌	6.82	2016年8月11日	7.50	30,106	279,081.59	205,322.92	-
002280	联络互动	2016年4月25日	重大资产重组停牌	19.71	-	-	10,200	237,117.95	201,042.00	-
000547	航天发展	2016年4月	重大资产	15.36	-	-	12,533	269,040.27	192,506.88	-

		19 日	重组 停牌								
000511	*ST 烯碳	2016 年 4 月 26 日	重大 事项 停牌	8.92	-	-	19,722	210,844.50	175,920.24	-	
300166	东方 国信	2016 年 6 月 8 日	重大 资产 重组 停牌	27.47	-	-	5,900	176,832.00	162,073.00	-	
000629	*ST 钒钛	2016 年 5 月 26 日	重大 资产 重组 停牌	2.39	-	-	65,740	261,268.20	157,118.60	-	
002266	浙富 控股	2016 年 5 月 25 日	重大 事项 停牌	5.35	-	-	25,719	234,835.58	137,596.65	-	
002190	成飞 集成	2016 年 4 月 21 日	重大 事项 停牌	35.44	2016 年 7 月 12 日	38.98	3,183	144,250.85	112,805.52	-	
002555	三七 互娱	2016 年 3 月 10 日	重大 资产 重组 停牌	18.10	2016 年 8 月 16 日	19.91	6,200	144,677.26	112,220.00	-	
000975	银泰 资源	2016 年 4 月 19 日	重大 资产 重组 停牌	15.00	-	-	7,428	124,535.23	111,420.00	-	
300032	金龙 机电	2016 年 6 月 28 日	重大 事项 停牌	20.10	2016 年 7 月 7 日	19.80	5,300	147,819.95	106,530.00	-	
000401	冀东 水泥	2016 年 4 月 6 日	重大 资产 重组 停牌	10.90	2016 年 7 月 14 日	11.32	8,990	115,569.17	97,991.00	-	
002052	同洲 电子	2016 年 1 月 12 日	重大 事项 停牌	10.03	-	-	9,423	135,148.68	94,512.69	-	
300052	中青 宝	2016 年 6 月 8 日	重大 资产 重组 停牌	22.03	-	-	2,919	82,483.98	64,305.57	-	
000693	ST 华 泽	2016 年 3 月 1 日	重大 事项 停牌	12.50	-	-	4,421	79,098.18	55,262.50	-	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	8,700.00	-
未评级	-	-
合计	8,700.00	-

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	718,194.56	-	-	-	-	-	718,194.56
结算备付金	4,702.35	-	-	-	-	-	4,702.35
存出保证金	456.09	-	-	-	-	-	456.09
交易性金融资产	-	-	8,700.00	-	-	-74,285,407.75	74,294,107.75
应收利息	-	-	-	-	-	139.34	139.34
资产总计	723,353.00	-	8,700.00	-	-	-74,285,547.09	75,017,600.09
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	54,733.32	54,733.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	30,769.44	30,769.44
应付托管费	-	-	-	-	-	6,153.87	6,153.87
应付交易费用	-	-	-	-	-	10,738.85	10,738.85

其他负债	-	-	-	-	-	249,424.32	249,424.32
负债总计	-	-	-	-	-	351,819.80	351,819.80
利率敏感度缺口	723,353.00	-	8,700.00	-	-	-73,933,727.29	74,665,780.29
上年度末 2015 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	1,840,816.97	-	-	-	-	-	1,840,816.97
结算备付金	1,863.04	-	-	-	-	-	1,863.04
存出保证金	4,589.96	-	-	-	-	-	4,589.96
交易性金融资产	-	-	13,600.00	-	-	-85,281,096.35	85,294,696.35
应收证券清算款	-	-	-	-	-	74,497.91	74,497.91
应收利息	-	-	-	-	-	373.88	373.88
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,847,269.97	-	13,600.00	-	-	-85,355,968.14	87,216,838.11
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	37,285.08	37,285.08
应付托管费	-	-	-	-	-	7,457.00	7,457.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	15,556.04	15,556.04
其他负债	-	-	-	-	-	225,000.00	225,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	285,298.12	285,298.12
利率敏感度缺口	1,847,269.97	-	13,600.00	-	-	-85,070,670.02	86,931,539.99

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：基金持有的可转债的市场风险在附注 6.4.13.4.3.2 中进行披露；除此之外，本基金本报告期末及上年度末计息资产仅包括银行存款、部分应收申购款、结算备付金及存出保证金，且均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，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	74,285,407.75	99.49	85,281,096.35	98.10
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	8,700.00	0.01	13,600.00	0.02
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	74,294,107.75	99.50	85,294,696.35	98.12

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。

6.4.13.4.3.2 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密切相关；		
	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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	深证 300 指数上涨 5%	3,695,537.62	4,326,034.56
	深证 300 指数下跌 5%	-3,695,537.62	-4,326,034.56

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。

6.4.14 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	74,285,407.75	99.02
	其中：股票	74,285,407.75	99.02
2	固定收益投资	8,700.00	0.01
	其中：债券	8,700.00	0.01
	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	722,896.91	0.96
7	其他各项资产	595.43	0.00
8	合计	75,017,600.09	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	1,050,830.50	1.41
B	采矿业	975,247.75	1.31
C	制造业	39,555,509.68	52.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,125,050.46	1.51
E	建筑业	1,055,005.97	1.41
F	批发和零售业	1,761,144.47	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,157,752.77	13.60
J	金融业	6,200,932.18	8.30
K	房地产业	6,812,513.41	9.12
L	租赁和商务服务业	1,432,775.11	1.92
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,188,103.51	1.59

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	383,732.21	0.51
R	文化、体育和娱乐业	2,266,024.23	3.03
S	综合	320,785.50	0.43
	合计	74,285,407.75	99.49

7.2.2 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	163,798	4,001,585.14	5.36
2	000651	格力电器	77,348	1,486,628.56	1.99
3	000333	美的集团	56,907	1,349,834.04	1.81
4	000001	平安银行	137,921	1,199,912.70	1.61
5	000858	五粮液	30,868	1,004,136.04	1.34
6	000725	京东方A	425,008	981,768.48	1.31
7	300104	乐视网	16,873	892,750.43	1.20
8	000776	广发证券	50,592	847,921.92	1.14
9	300059	东方财富	35,360	784,992.00	1.05
10	002450	康得新	43,189	738,531.90	0.99
11	002024	苏宁云商	66,025	717,031.50	0.96
12	002415	海康威视	33,174	711,914.04	0.95
13	002304	洋河股份	9,283	667,633.36	0.89
14	000783	长江证券	50,399	584,628.40	0.78
15	002673	西部证券	22,494	581,694.84	0.78
16	000166	申万宏源	68,723	577,960.43	0.77
17	000063	中兴通讯	39,183	561,884.22	0.75
18	002594	比亚迪	9,193	560,864.93	0.75
19	300017	网宿科技	8,256	554,803.20	0.74
20	002736	国信证券	30,575	527,418.75	0.71
21	002739	万达院线	6,400	511,360.00	0.68
22	000423	东阿阿胶	9,300	491,319.00	0.66
23	000625	长安汽车	35,881	490,493.27	0.66

24	002230	科大讯飞	14,790	485,851.50	0.65
25	000503	海虹控股	12,050	484,530.50	0.65
26	000538	云南白药	7,358	473,119.40	0.63
27	300024	机器人	18,584	471,847.76	0.63
28	001979	招商蛇口	32,510	463,267.50	0.62
29	002466	天齐锂业	10,700	456,783.00	0.61
30	000100	TCL 集团	137,015	450,779.35	0.60
31	002142	宁波银行	29,555	436,822.90	0.59
32	002202	金风科技	27,683	418,843.79	0.56
33	002241	歌尔股份	14,595	418,584.60	0.56
34	002065	东华软件	16,230	407,373.00	0.55
35	000768	中航飞机	19,720	388,286.80	0.52
36	000839	中信国安	18,084	385,370.04	0.52
37	002456	欧菲光	12,838	378,721.00	0.51
38	300070	碧水源	25,421	378,264.48	0.51
39	300027	华谊兄弟	26,954	364,957.16	0.49
40	000069	华侨城 A	55,881	357,638.40	0.48
41	000568	泸州老窖	11,822	351,113.40	0.47
42	000728	国元证券	20,971	350,635.12	0.47
43	002465	海格通信	28,330	352,425.20	0.47
44	002405	四维图新	13,894	341,792.40	0.46
45	000895	双汇发展	16,318	340,719.84	0.46
46	002236	大华股份	25,445	333,329.50	0.45
47	000157	中联重科	79,843	329,751.59	0.44
48	002008	大族激光	14,340	327,525.60	0.44
49	002500	山西证券	19,749	327,043.44	0.44
50	002340	格林美	37,156	325,858.12	0.44
51	002183	怡亚通	22,710	325,207.20	0.44
52	000917	电广传媒	19,673	325,194.69	0.44
53	000686	东北证券	24,904	321,510.64	0.43
54	000009	中国宝安	23,415	320,785.50	0.43
55	000559	万向钱潮	20,523	320,158.80	0.43
56	002252	上海莱士	8,474	319,300.32	0.43
57	300124	汇川技术	16,735	324,659.00	0.43
58	000338	潍柴动力	39,862	311,322.22	0.42
59	300168	万达信息	12,088	314,167.12	0.42
60	000623	吉林敖东	12,216	304,789.20	0.41
61	000793	华闻传媒	30,018	296,577.84	0.40
62	002385	大北农	36,037	290,458.22	0.39

63	002007	华兰生物	9,181	288,283.40	0.39
64	000876	新希望	34,606	287,921.92	0.39
65	002475	立讯精密	14,588	286,654.20	0.38
66	300408	三环集团	15,600	280,176.00	0.38
67	000540	中天城投	44,476	277,085.48	0.37
68	000750	国海证券	37,084	274,050.76	0.37
69	000630	铜陵有色	107,135	272,122.90	0.36
70	000826	启迪桑德	8,821	269,481.55	0.36
71	300003	乐普医疗	14,706	268,237.44	0.36
72	000413	东旭光电	31,165	267,707.35	0.36
73	000661	长春高新	2,495	266,166.60	0.36
74	300033	同花顺	3,332	271,391.40	0.36
75	300072	三聚环保	9,598	265,288.72	0.36
76	000718	苏宁环球	19,811	259,325.99	0.35
77	300315	掌趣科技	25,208	264,431.92	0.35
78	000963	华东医药	3,798	255,985.20	0.34
79	000060	中金岭南	24,332	253,782.76	0.34
80	002049	紫光国芯	5,761	253,195.95	0.34
81	002176	江特电机	16,000	246,400.00	0.33
82	300088	长信科技	16,374	243,481.38	0.33
83	002074	国轩高科	6,159	243,095.73	0.33
84	000977	浪潮信息	10,218	239,612.10	0.32
85	002030	达安基因	8,587	238,718.60	0.32
86	300253	卫宁健康	9,639	238,083.30	0.32
87	000748	长城信息	11,870	232,889.40	0.31
88	000887	中鼎股份	10,396	229,855.56	0.31
89	002081	金螳螂	22,822	228,676.44	0.31
90	000997	新大陆	11,410	228,656.40	0.31
91	300144	宋城演艺	9,387	233,830.17	0.31
92	002400	省广股份	16,167	228,439.71	0.31
93	000425	徐工机械	74,298	227,351.88	0.30
94	000402	金融街	23,280	226,281.60	0.30
95	002292	奥飞娱乐	7,524	225,343.80	0.30
96	000988	华工科技	11,146	223,477.30	0.30
97	000792	盐湖股份	10,476	221,043.60	0.30
98	000970	中科三环	15,205	220,624.55	0.30
99	002439	启明星辰	8,720	225,237.60	0.30
100	300431	暴风集团	3,100	224,750.00	0.30
101	000983	西山煤电	26,670	217,360.50	0.29

102	300058	蓝色光标	22,248	216,028.08	0.29
103	002179	中航光电	4,968	215,213.76	0.29
104	002038	双鹭药业	7,128	215,123.04	0.29
105	000998	隆平高科	11,248	213,487.04	0.29
106	000050	深天马 A	10,203	212,936.61	0.29
107	300383	光环新网	5,800	219,820.00	0.29
108	002426	胜利精密	21,996	216,660.60	0.29
109	002085	万丰奥威	12,500	214,875.00	0.29
110	300498	温氏股份	5,920	214,422.40	0.29
111	300015	爱尔眼科	5,837	213,225.61	0.29
112	002273	水晶光电	7,566	211,772.34	0.28
113	000709	河钢股份	76,300	211,351.00	0.28
114	002129	中环股份	24,829	205,832.41	0.28
115	002460	赣锋锂业	6,200	207,390.00	0.28
116	000415	渤海金控	30,106	205,322.92	0.27
117	000738	中航动控	7,648	201,907.20	0.27
118	000656	金科股份	52,113	199,071.66	0.27
119	000046	泛海控股	19,618	198,337.98	0.27
120	002280	联络互动	10,200	201,042.00	0.27
121	300077	国民技术	9,976	197,524.80	0.26
122	002701	奥瑞金	22,272	196,661.76	0.26
123	002152	广电运通	11,907	195,751.08	0.26
124	000039	中集集团	13,772	195,149.24	0.26
125	000581	威孚高科	9,577	193,072.32	0.26
126	300002	神州泰岳	18,094	192,520.16	0.26
127	000547	航天发展	12,533	192,506.88	0.26
128	002299	圣农发展	7,299	189,044.10	0.25
129	000078	海王生物	25,442	189,034.06	0.25
130	300251	光线传媒	15,906	183,873.36	0.25
131	002310	东方园林	7,658	183,179.36	0.25
132	300418	昆仑万维	6,600	186,582.00	0.25
133	002276	万马股份	9,300	184,233.00	0.25
134	300079	数码视讯	21,382	183,243.74	0.25
135	002004	华邦健康	19,988	182,490.44	0.24
136	002422	科伦药业	11,716	180,543.56	0.24
137	002001	新 和 成	8,508	179,774.04	0.24
138	002311	海大集团	11,294	178,106.38	0.24
139	000511	*ST 烯碳	19,722	175,920.24	0.24
140	002573	清新环境	10,799	182,719.08	0.24

141	002470	金正大	22,684	182,606.20	0.24
142	300133	华策影视	11,710	182,324.70	0.24
143	002075	沙钢股份	12,600	180,432.00	0.24
144	002312	三泰控股	9,503	180,081.85	0.24
145	002168	深圳惠程	12,416	174,817.28	0.23
146	002191	劲嘉股份	15,039	174,302.01	0.23
147	000031	中粮地产	18,306	172,625.58	0.23
148	000712	锦龙股份	8,253	171,332.28	0.23
149	000778	新兴铸管	36,886	171,151.04	0.23
150	000671	阳光城	28,805	171,101.70	0.23
151	300146	汤臣倍健	12,588	170,441.52	0.23
152	000598	兴蓉环境	32,093	169,451.04	0.23
153	000400	许继电气	10,972	169,407.68	0.23
154	300055	万邦达	9,579	174,433.59	0.23
155	300244	迪安诊断	5,170	170,506.60	0.23
156	002491	通鼎互联	9,900	168,894.00	0.23
157	002223	鱼跃医疗	5,284	167,608.48	0.22
158	000758	中色股份	21,616	167,524.00	0.22
159	000697	炼石有色	7,291	166,599.35	0.22
160	000729	燕京啤酒	21,876	166,038.84	0.22
161	000930	中粮生化	15,100	165,798.00	0.22
162	000410	沈阳机床	9,839	165,098.42	0.22
163	002294	信立泰	6,002	163,254.40	0.22
164	002353	杰瑞股份	8,411	162,164.08	0.22
165	002153	石基信息	6,138	161,920.44	0.22
166	300170	汉得信息	10,918	165,735.24	0.22
167	300166	东方国信	5,900	162,073.00	0.22
168	300367	东方网力	6,500	161,395.00	0.22
169	000999	华润三九	6,612	160,142.64	0.21
170	000012	南玻A	13,888	159,156.48	0.21
171	002104	恒宝股份	9,635	158,399.40	0.21
172	002477	雏鹰农牧	26,452	157,918.44	0.21
173	002018	华信国际	16,600	157,700.00	0.21
174	000629	*ST 钒钛	65,740	157,118.60	0.21
175	000901	航天科技	3,902	156,665.30	0.21
176	000800	一汽轿车	14,217	154,680.96	0.21
177	000566	海南海药	14,176	154,660.16	0.21
178	000883	湖北能源	33,243	153,915.09	0.21
179	000979	中弘股份	55,944	153,286.56	0.21

180	300267	尔康制药	11,200	160,384.00	0.21
181	300274	阳光电源	6,572	160,356.80	0.21
182	002138	顺络电子	8,700	157,731.00	0.21
183	002657	中科金财	2,832	155,590.08	0.21
184	002343	慈文传媒	3,200	155,200.00	0.21
185	300001	特锐德	7,100	153,999.00	0.21
186	000061	农产品	12,570	152,851.20	0.20
187	002308	威创股份	9,300	152,799.00	0.20
188	002092	中泰化学	18,033	152,559.18	0.20
189	000938	紫光股份	2,500	152,200.00	0.20
190	002224	三力士	6,500	150,475.00	0.20
191	000690	宝新能源	22,173	150,332.94	0.20
192	002022	科华生物	7,038	149,979.78	0.20
193	002467	二六三	9,545	147,088.45	0.20
194	000627	天茂集团	19,016	146,993.68	0.20
195	000028	国药一致	2,255	146,800.50	0.20
196	000878	云南铜业	14,323	145,808.14	0.20
197	002410	广联达	10,653	152,337.90	0.20
198	300115	长盈精密	7,386	152,151.60	0.20
199	300273	和佳股份	7,858	150,480.70	0.20
200	002185	华天科技	11,323	144,141.79	0.19
201	000021	深科技	13,078	143,988.78	0.19
202	000960	锡业股份	12,425	143,633.00	0.19
203	000066	长城电脑	11,200	142,800.00	0.19
204	000829	天音控股	10,544	140,762.40	0.19
205	000516	国际医学	23,892	139,768.20	0.19
206	002161	远望谷	9,366	139,459.74	0.19
207	002146	荣盛发展	20,605	138,465.60	0.19
208	300014	亿纬锂能	3,300	142,527.00	0.19
209	300216	千山药机	4,500	142,335.00	0.19
210	002714	牧原股份	2,800	141,484.00	0.19
211	300199	翰宇药业	6,900	140,415.00	0.19
212	300291	华录百纳	5,900	138,827.00	0.19
213	002266	浙富控股	25,719	137,596.65	0.18
214	001696	宗申动力	12,593	137,515.56	0.18
215	002428	云南锗业	7,840	134,691.20	0.18
216	000592	平潭发展	19,834	134,474.52	0.18
217	002051	中工国际	6,824	134,228.08	0.18
218	002250	联化科技	9,187	131,557.84	0.18

219	002073	软控股份	10,844	130,670.20	0.18
220	002489	浙江永强	17,300	137,016.00	0.18
221	300010	立思辰	6,500	136,370.00	0.18
222	002368	太极股份	3,820	135,724.60	0.18
223	002055	得润电子	4,400	134,728.00	0.18
224	002474	榕基软件	7,095	134,095.50	0.18
225	002501	利源精制	12,396	133,876.80	0.18
226	300085	银之杰	4,420	132,158.00	0.18
227	002665	首航节能	16,740	132,078.60	0.18
228	002375	亚厦股份	11,527	130,255.10	0.17
229	000786	北新建材	14,344	130,243.52	0.17
230	000543	皖能电力	18,163	129,683.82	0.17
231	000667	美好集团	36,146	129,041.22	0.17
232	002424	贵州百灵	7,461	128,329.20	0.17
233	000027	深圳能源	19,769	126,126.22	0.17
234	000973	佛塑科技	11,900	124,236.00	0.17
235	300026	红日药业	7,512	130,633.68	0.17
236	300043	互动娱乐	9,151	129,669.67	0.17
237	002284	亚太股份	6,600	125,994.00	0.17
238	300134	大富科技	4,131	123,764.76	0.17
239	002013	中航机电	9,076	122,344.48	0.16
240	000687	华讯方舟	6,169	122,146.20	0.16
241	000825	太钢不锈	38,565	121,865.40	0.16
242	002195	二三四五	9,912	121,818.48	0.16
243	000777	中核科技	5,143	121,169.08	0.16
244	002063	远光软件	7,820	120,819.00	0.16
245	000006	深振业A	16,334	120,381.58	0.16
246	002002	鸿达兴业	6,393	120,188.40	0.16
247	002522	浙江众成	6,500	121,875.00	0.16
248	002268	卫士通	3,300	117,942.00	0.16
249	002642	荣之联	4,428	116,500.68	0.16
250	002570	贝因美	9,035	115,557.65	0.15
251	002261	拓维信息	8,200	113,406.00	0.15
252	002190	成飞集成	3,183	112,805.52	0.15
253	000816	智慧农业	18,997	112,272.27	0.15
254	000156	华数传媒	6,040	112,042.00	0.15
255	000975	银泰资源	7,428	111,420.00	0.15
256	002431	棕榈股份	9,642	110,883.00	0.15
257	000851	高鸿股份	8,549	110,196.61	0.15

258	000939	凯迪生态	12,301	110,093.95	0.15
259	002130	沃尔核材	6,800	109,344.00	0.15
260	300147	香雪制药	7,693	113,317.89	0.15
261	002437	誉衡药业	12,998	113,082.60	0.15
262	002285	世联行	14,458	112,627.82	0.15
263	002555	三七互娱	6,200	112,220.00	0.15
264	300182	捷成股份	6,485	110,958.35	0.15
265	000875	吉电股份	19,700	110,517.00	0.15
266	002440	闰土股份	7,418	110,157.30	0.15
267	002390	信邦制药	11,900	109,956.00	0.15
268	300433	蓝思科技	3,900	109,668.00	0.15
269	002396	星网锐捷	5,346	105,316.20	0.14
270	002399	海普瑞	5,951	103,904.46	0.14
271	000558	莱茵体育	6,200	102,548.00	0.14
272	002019	亿帆鑫富	6,600	101,508.00	0.14
273	300032	金龙机电	5,300	106,530.00	0.14
274	300212	易华录	3,553	105,772.81	0.14
275	002095	生意宝	1,819	101,845.81	0.14
276	300496	中科创达	1,500	101,580.00	0.14
277	002625	龙生股份	2,300	101,154.00	0.14
278	000937	冀中能源	18,790	99,962.80	0.13
279	002011	盾安环境	8,852	99,850.56	0.13
280	000685	中山公用	9,563	99,263.94	0.13
281	000158	常山股份	7,100	98,619.00	0.13
282	000401	冀东水泥	8,990	97,991.00	0.13
283	002052	同洲电子	9,423	94,512.69	0.13
284	000961	中南建设	16,640	93,350.40	0.13
285	300257	开山股份	6,075	100,359.00	0.13
286	300202	聚龙股份	4,124	99,842.04	0.13
287	300226	上海钢联	1,978	99,691.20	0.13
288	002681	奋达科技	5,654	95,439.52	0.13
289	002563	森马服饰	8,800	95,304.00	0.13
290	002429	兆驰股份	11,247	94,249.86	0.13
291	000898	鞍钢股份	23,754	90,977.82	0.12
292	000732	泰禾集团	4,500	87,480.00	0.12
293	000681	视觉中国	3,680	87,032.00	0.12
294	000062	深圳华强	3,131	84,537.00	0.11
295	000861	海印股份	17,100	84,474.00	0.11
296	002344	海宁皮城	8,352	81,432.00	0.11

297	002498	汉缆股份	18,600	80,724.00	0.11
298	300188	美亚柏科	3,000	79,920.00	0.11
299	300333	兆日科技	3,300	78,540.00	0.11
300	000539	粤电力A	15,073	75,666.46	0.10
301	002568	百润股份	3,300	72,600.00	0.10
302	002010	传化股份	3,300	65,307.00	0.09
303	300052	中青宝	2,919	64,305.57	0.09
304	002416	爱施德	3,100	61,566.00	0.08
305	000693	ST 华泽	4,421	55,262.50	0.07
306	002027	分众传媒	3,300	54,483.00	0.07

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	002739	万达院线	322,280.47	0.37
2	300408	三环集团	279,743.00	0.32
3	002176	江特电机	247,665.00	0.28
4	300431	暴风集团	224,790.00	0.26
5	300383	光环新网	219,482.00	0.25
6	002018	华信国际	218,194.00	0.25
7	002426	胜利精密	213,271.16	0.25
8	002085	万丰奥威	212,710.00	0.24
9	002460	赣锋锂业	207,018.00	0.24
10	300418	昆仑万维	188,276.00	0.22
11	002075	沙钢股份	178,878.00	0.21
12	300367	东方网力	162,913.00	0.19
13	000066	长城电脑	161,162.00	0.19
14	000748	长城信息	157,115.00	0.18
15	002343	慈文传媒	156,608.00	0.18
16	002308	威创股份	153,401.00	0.18

17	002224	三力士	151,428.00	0.17
18	300014	亿纬锂能	143,589.00	0.17
19	002714	牧原股份	142,082.00	0.16
20	300010	立思辰	136,348.00	0.16

注：买入金额按买卖成交金额填列，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	002219	恒康医疗	214,116.05	0.25
2	002155	湖南黄金	169,088.90	0.19
3	000402	金融街	160,593.00	0.18
4	000831	*ST 五稀	150,200.78	0.17
5	002050	三花股份	138,789.10	0.16
6	002048	宁波华翔	133,138.60	0.15
7	002151	北斗星通	118,424.66	0.14
8	000616	海航投资	115,983.29	0.13
9	000061	农产品	114,018.00	0.13
10	000751	锌业股份	112,320.00	0.13
11	002318	久立特材	112,085.25	0.13
12	000541	佛山照明	111,552.40	0.13
13	002106	莱宝高科	109,423.44	0.13
14	002024	苏宁云商	109,194.96	0.13
15	000783	长江证券	108,438.00	0.12
16	002005	德豪润达	106,054.45	0.12
17	002603	以岭药业	105,990.86	0.12
18	000572	海马汽车	105,392.36	0.12
19	000897	津滨发展	93,079.05	0.11
20	300005	探路者	93,010.10	0.11

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	7,915,699.73
卖出股票收入（成交）总额	6,034,465.07

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

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）	8,700.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,700.00	0.01

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

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	127003	海印转债	87	8,700.00	0.01

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

注：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

注：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

注：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

本基金投资前十名证券中的广发证券（000776）于 2015 年 9 月 12 日公告收到《中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]71 号）。中国证券监督管理委员会拟对广发证券涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案做出行政处罚。我司经过研究评估，认为此事件对广发证券经营业绩未产生重大的实质影响，对其投资价值未产生实质影响。本基金持有该股经过合理的投资决策授权审批，符合指数基金投资管理规定。

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	456.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	139.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	595.43

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科 A	4,001,585.14	5.36	重大资产重组停牌
2	000651	格力电器	1,486,628.56	1.99	重大事项停牌

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
1,218	47,248.76	41,751,573.00	72.55%	15,797,418.00	27.45%

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	40,614,142.00	70.57%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“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”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	中国工商银行股份有限公司-汇添富深证 300 交易型开放式指数证	40,614,142.00	70.57%

2	北京无限立通通讯技术有限公 司	708,499.00	1.23%
3	苗桂玲	700,000.00	1.22%
4	王仰东	682,500.00	1.19%
5	杨卓兴	489,903.00	0.85%
6	沈东来	404,814.00	0.70%
7	凌蔚盈	390,000.00	0.68%
8	彭志红	330,000.00	0.57%
9	梁国钊	300,012.00	0.52%
10	沈松	280,000.00	0.49%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金的基金管理人从业人员本报告期末未持有本基金。

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、基金投资和研究部 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	55,948,991.00
本报告期基金总申购份额	11,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	9,600,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	57,548,991.00

§ 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 2016 年 1 月 14 日公告，陈晓翔先生不再担任汇添富价值精选混合型证券投资基金的基金经理，由劳杰男先生单独管理该基金。
- 2、《汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 1 月 21 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。
- 3、《汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 11 日正式生效，何旻先生和李怀定先生任该基金的基金经理。
- 4、基金管理人 2016 年 3 月 12 日公告，增聘马翔先生担任汇添富民营活力混合型证券投资基金的基金经理，同时，朱晓亮先生不再担任该基金的基金经理。
- 5、《汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 16 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。
- 6、基金管理人 2016 年 4 月 2 日公告，陈灿辉先生不再担任副总经理。
- 7、基金管理人 2016 年 4 月 9 日公告，增聘胡昕炜先生担任汇添富消费行业混合型证券投资基金的基金经理，同时，朱晓亮先生不再担任该基金的基金经理。
- 8、《汇添富盈安保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 19 日正式生效，曾刚先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。
- 9、《汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 3 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。
- 10、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。
- 11、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。
- 12、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲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，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。
- 13、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲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，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。
- 14、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富添富货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。
- 15、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

16、本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，针对中国证监会出具的责令改正措施，以及对相关负责人的警示，公司高度重视，逐一落实各项整改要求，针对性的制定、实施整改措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理的能力。目前公司已完成相关整改工作。

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	13,950,164.80	100.00%	12,712.83	100.00%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-

华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
中国建银投资	1	-	-	-	-	-
中投证券	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	15,124.01	100.00%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投资	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金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，基金会会计负责协助及时催缴。

2、此 40 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、中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产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、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金、汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金共用。本基金本报告期内新增 2 家证券公司的 2 个交易单元：中信证券（深交所交易单元）、长城证券（深交所交易单元）。

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旗下基金 2015 年年度资产净值的公告	管理人网站	2016 年 1 月 4 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断后调整旗下部分基金申购与赎回开放时间的公告	管理人网站	2016 年 1 月 4 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于调整指数熔断机制下的基金申购与赎回开放时间的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 上交所, 深交所	2016 年 1 月 4 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于指数熔断期间旗下场内基金申购赎回业务安排的提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2016 年 1 月 6 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断后调整旗下部分基金申购与赎回开放时间的公告	管理人网站	2016 年 1 月 7 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于人员在子公司兼职情况变更的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 3 月 16 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告（副总经理）	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 4 月 2 日
8	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（2016	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管	2016 年 4 月 29 日

	年第 1 号)	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
2016 年 8 月 27 日