

深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 26 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 2017 年 8 月 24 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 2017 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 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 13 |
| 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..... | 14 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 17 |
| 6.1 资产负债表..... | 17 |
| 6.2 利润表..... | 18 |

| | |
|---|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 19 |
| 6.4 报表附注 | 20 |
| §7 投资组合报告 | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 39 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 | 39 |
| 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 | 40 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 48 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 49 |
| 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 | 50 |
| 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 | 50 |
| 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 | 50 |
| 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 | 50 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 50 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 50 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 50 |
| §8 基金份额持有人信息 | 52 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 52 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 | 52 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 53 |
| 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 | 53 |
| §9 开放式基金份额变动 | 54 |
| §10 重大事件揭示 | 55 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 55 |
| 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 | 55 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 56 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 56 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 56 |
| 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 | 56 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 56 |
| 10.8 其他重大事件 | 59 |

| | |
|--|-----------|
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 60 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 60 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 60 |
| §12 备查文件目录 | 61 |
| 12.1 备查文件目录..... | 61 |
| 12.2 存放地点..... | 61 |
| 12.3 查阅方式..... | 61 |

§ 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) |
| 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 | 68,748,991.00 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 | 郭明 |
| | 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 号 6 栋 538 室 | 北京市西城区复兴门内大街 55 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | -3,115,974.40 |
| 本期利润 | 5,524,731.36 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0964 |
| 本期加权平均净值利润率 | 7.51% |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.68% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 23,642,725.99 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3439 |
| 期末基金资产净值 | 92,391,716.99 |
| 期末基金份额净值 | 1.3439 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 34.39% |

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 | 7.45% | 0.81% | 7.37% | 0.81% | 0.08% | 0.00% |
| 过去三个月 | 3.23% | 0.85% | 2.86% | 0.85% | 0.37% | 0.00% |
| 过去六个月 | 6.68% | 0.80% | 6.58% | 0.81% | 0.10% | -0.01% |
| 过去一年 | 3.58% | 0.86% | 4.06% | 0.87% | -0.48% | -0.01% |
| 过去三年 | 55.01% | 1.90% | 55.20% | 1.92% | -0.19% | -0.02% |
| 自基金合同 | 34.39% | 1.65% | 27.53% | 1.69% | 6.86% | -0.04% |

| | | | | | | |
|------------|--|--|--|--|--|--|
| 生效日起至 今 | | | | | | |
|------------|--|--|--|--|--|--|

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 132,724,224 元人民币。截止到 2017 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 2898.83 亿元，有效客户数约 1500 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 85 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、汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）、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、汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金、汇添富盈稳保本混合型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫保本混合型证券投资基金、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金、汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）、汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金、汇添富鑫利债券型证券投资基金、汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、汇添富中国高端制造股票型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富精选美元债债券型证券投资基金、汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金。

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 | | |
| 赖中立 | 汇添富黄金及贵金属基金（LOF）的基金经理、汇添富恒生指数分级（QDII）基金、汇添富深证300ETF | 2015年1月6日 | - | 10年 | 国籍：中国，学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属基金（LOF）的基金经理，2014年3月6日至今任 |

| | | | | | |
|-----|---|-----------------|---|-----|--|
| | 基金、汇添富深证 300ETF 联接基金、汇添富中证环境治理指数 (LOF) 基金、汇添富优选回报混合基金的基金经理。 | | | | 汇添富恒生指数分级 (QDII) 基金的基金经理, 2015 年 1 月 6 日至今任汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理, 2015 年 5 月 26 日至 2016 年 7 月 13 日任汇添富香港优势混合基金的基金经理, 2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证环境治理指数 (LOF) 基金的基金经理, 2017 年 5 月 18 日至今任汇添富优选回报混合基金的基金经理。 |
| 过 蓓 | 汇添富中证主要消费 ETF、汇添富中证医药卫生 ETF、汇添富中证能源 ETF、汇添富中证金融地产 ETF、汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 联接基金、汇添富主要消费 ETF 联接基金、汇添富中证生物科技指数 (LOF) 基金、汇添富中证中药指数 (LOF) 基金的基金 | 2015 年 8 月 18 日 | - | 6 年 | 国籍: 中国, 学历: 中国科学技术大学金融工程博士研究生, 相关业务资格: 证券投资基金从业资格。从业经历: 曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理, 2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费 ETF 基金、中证医药卫生 ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金、汇添富中证主要消费 ETF 联接基金的基金经理, 2015 年 8 月 18 日至今任汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理, 2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技指数 (LOF) 基金的基金经理, 2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证中药指数 (LOF) 基金的基金经理。 |

| | | | | | |
|--|-----|--|--|--|--|
| | 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，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人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 8 次，由于组合投资策略导致，并经过公司

内部风控审核。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

2017 年上半年沪深 300 指数上涨 10.78%，全球股市表现良好，人民币币值稳中回升。实体经济较为稳健，工业生产恢复，消费增速维持平稳。金融去杠杆是上半年的政策主线，前 5 个月市场流动性压力全面上升，至 6 月央行为预防半年度末资金紧张提供了部分流动性，使得流动性在紧平衡背景下出现边际宽松，货币政策走向稳健。龙头股在上半年表现优异，市场在寻求经济不确定背景下的确定性增长。进入 6 月份，中小板股票出现了 5%以上的反弹，部分中小盘成长股显示出投资价值。

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 指数上涨 6.58%，本基金在报告期内累计收益率为 6.68%，收益率超越业绩比较基准 0.10%。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 0.0113%，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

今年上半年的经济表现超预期，投资仍是重要支撑，但当前的主要矛盾仍然是去杠杆，相应的政府也在金融工作会议中提出“稳增长、调结构、控总量”，控制货币总量的重要性提升，货币政策由宽松转向稳健，从源头抑制投资冲动是今年的常态。因此，虽然下半年供给侧改革、环保限产等行业政策面的因素将促使周期股继续维持一段时间的强势，但当前周期股的价格已经反应了供给侧收缩的效果，而它们的崛起并不意味着重工业经济的重新到来，也并不意味着需求的回暖，当前时点整体上介入周期板块的性价比已经在下降。在蓝筹股回调的时机中布局基本面稳定、估值合理的品种是最佳选择，尤其对于资金中长期投资的投资者，更应当排除市场杂音，在逻辑未发生变化前将重心集中在核心资产和龙头上。同时，中盘二线蓝筹经过一年半的调整，已经出现较好的投资价值，资金热情从一线蓝筹扩散到二线蓝筹可期。

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，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，深证 300 交易型开放式指数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深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2017 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,488,408.49 | 665,090.68 |
| 结算备付金 | | 2,394.43 | - |
| 存出保证金 | | 316.34 | 90.87 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 91,318,018.48 | 73,767,312.14 |
| 其中：股票投资 | | 91,318,018.48 | 73,767,312.14 |
| 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 | | - | 351,050.14 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 296.34 | 133.03 |
| 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 | | 92,809,434.08 | 74,783,676.86 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 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 | | 181,138.11 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 32,543.63 | 32,471.99 |
| 应付托管费 | | 6,508.72 | 6,494.38 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 13,266.48 | 12,531.98 |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 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 | 184,260.15 | 220,328.55 |
| 负债合计 | | 417,717.09 | 271,826.90 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 68,748,991.00 | 59,148,991.00 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 23,642,725.99 | 15,362,858.96 |
| 所有者权益合计 | | 92,391,716.99 | 74,511,849.96 |
| 负债和所有者权益总计 | | 92,809,434.08 | 74,783,676.86 |

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 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3439 元，基金份额总额 68,748,991.00 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 6,005,523.54 | -13,246,242.46 |
| 1.利息收入 | | 1,944.06 | 3,456.45 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 1,944.06 | 3,449.05 |
| 债券利息收入 | | - | 7.40 |
| 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） | | -2,642,376.67 | -4,663,261.58 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -3,141,813.55 | -5,132,253.41 |
| 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 | 6.4.7.13.1 | - | - |
| 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 | 499,436.88 | 467,475.12 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 8,640,705.76 | -8,608,222.59 |
| 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 | 5,250.39 | 21,785.26 |
| 减：二、费用 | | 480,792.18 | 488,903.45 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 181,940.66 | 178,676.56 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 36,388.12 | 35,735.29 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 23,131.25 | 19,985.28 |
| 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 | 239,332.15 | 254,506.32 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 5,524,731.36 | -13,735,145.91 |

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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） | 59,148,991.00 | 15,362,858.96 | 74,511,849.96 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 5,524,731.36 | 5,524,731.36 |
| 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） | 9,600,000.00 | 2,755,135.67 | 12,355,135.67 |
| 其中：1. 基金申购款 | 16,000,000.00 | 4,740,499.46 | 20,740,499.46 |
| 2. 基金赎回款 | -6,400,000.00 | -1,985,363.79 | -8,385,363.79 |
| 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） | 68,748,991.00 | 23,642,725.99 | 92,391,716.99 |
| 项目 | 上年度可比期间 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 |

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：

| | | |
|----------------|----------------|-----------------|
| _____ 张晖 _____ | _____ 李骁 _____ | _____ 雷青松 _____ |
| 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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。

6.4.6.2 营业税、增值税

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；

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以及金融同业往来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，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再

缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。

6.4.6.4 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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

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 2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 1,488,408.49 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 1,488,408.49 |

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 2017 年 6 月 30 日 | | |
|-------------------|------------------------|---------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 96,045,314.78 | 91,318,018.48 | -4,727,296.30 |
| 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 | 96,045,314.78 | 91,318,018.48 | -4,727,296.30 |

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 2017 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 295.26 |
| 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 | 0.99 |
| 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 | 0.09 |
| 合计 | 296.34 |

注：表中“其他”为应收结算保证金利息。

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 2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 13,266.48 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 13,266.48 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付信息披露费 | 54,712.18 |
| 应付审计费 | 24,795.19 |
| 应付上市费 | 29,752.78 |
| 应付指数使用费 | 75,000.00 |
| 合计 | 184,260.15 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 59,148,991.00 | 59,148,991.00 |
| 本期申购 | 16,000,000.00 | 16,000,000.00 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -6,400,000.00 | -6,400,000.00 |
| - 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 | 68,748,991.00 | 68,748,991.00 |

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 | 34,123,826.19 | -18,760,967.23 | 15,362,858.96 |
| 本期利润 | -3,115,974.40 | 8,640,705.76 | 5,524,731.36 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 5,271,868.74 | -2,516,733.07 | 2,755,135.67 |
| 其中：基金申购款 | 8,883,042.87 | -4,142,543.41 | 4,740,499.46 |
| 基金赎回款 | -3,611,174.13 | 1,625,810.34 | -1,985,363.79 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 36,279,720.53 | -12,636,994.54 | 23,642,725.99 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| | 活期存款利息收入 |
| 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 | 179.67 |
| 其他 | 1.85 |
| 合计 | 1,944.06 |

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -2,080,137.33 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | -1,061,676.22 |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | -3,141,813.55 |

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 7,603,029.90 |
| 减：卖出股票成本总额 | 9,683,167.23 |
| 买卖股票差价收入 | -2,080,137.33 |

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额 | 8,385,363.79 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 166,195.79 |
| 减：赎回股票成本总额 | 9,280,844.22 |
| 赎回差价收入 | -1,061,676.22 |

6.4.7.13 债券投资收益

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

注：本基金本期末未投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

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 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 499,436.88 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 499,436.88 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 8,640,705.76 |
| ——股票投资 | 8,640,705.76 |
| ——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 | 8,640,705.76 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | - |
| 替代损益 | 5,250.39 |
| 合计 | 5,250.39 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 23,131.25 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 23,131.25 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 34,712.18 |
| 账户维护费 | - |
| 指数使用费 | 150,000.00 |
| 银行划款费用 | 72.00 |
| 上市年费 | 29,752.78 |
| 合计 | 239,332.15 |

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 |

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 2017年1月1日至2017年6月30日 | | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016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 | 15,775,534.34 | 100.00% | 13,950,164.80 | 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 2017年1月1日至2017年6月30日 | | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016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 2017年1月1日至2017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 | 14,224.34 | 98.94% | 13,266.48 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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% |
|------------|-----------|---------|-----------|---------|

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 2017年1月1日至2017年6 月30日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 181,940.66 | 178,676.56 |
| 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 2017年1月1日至2017年6 月30日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 36,388.12 | 35,735.29 |

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末和上年度末未投资本基金。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 | 1,488,408.49 | 1,762.54 | 718,194.56 | 3,249.78 |

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

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 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 | 停牌原 | 期末 | 复牌日期 | 复牌 | 数量（股） | 期末 | 期末估值总额 |
|------|------|-----|-----|----|------|----|-------|----|--------|
|------|------|-----|-----|----|------|----|-------|----|--------|

| | | 期 | 因 | 估值单价 | | 开盘单价 | | 成本总额 | |
|--------|--------|-------------|----------|-------|------------|-------|---------|------------|------------|
| 300104 | 乐视网 | 2017年4月17日 | 重大资产重组停牌 | 30.68 | - | - | 17,673 | 963,216.74 | 542,207.64 |
| 000100 | TCL 集团 | 2017年4月21日 | 重大资产重组停牌 | 3.43 | 2017年7月26日 | 3.72 | 123,915 | 613,797.58 | 425,028.45 |
| 000656 | 金科股份 | 2017年5月5日 | 重大资产重组停牌 | 6.54 | 2017年7月5日 | 5.92 | 47,313 | 263,651.77 | 309,427.02 |
| 002252 | 上海莱士 | 2017年4月21日 | 重大资产重组停牌 | 20.24 | - | - | 13,613 | 273,801.21 | 275,527.12 |
| 000503 | 海虹控股 | 2017年5月11日 | 重大资产重组停牌 | 24.93 | - | - | 10,950 | 350,859.00 | 272,983.50 |
| 300088 | 长信科技 | 2016年9月12日 | 重大资产重组停牌 | 15.75 | 2017年8月9日 | 14.50 | 15,974 | 202,242.19 | 251,590.50 |
| 002426 | 胜利精密 | 2017年1月16日 | 重大资产重组停牌 | 7.68 | - | - | 29,096 | 271,479.75 | 223,457.28 |
| 000887 | 中鼎股份 | 2017年4月27日 | 重大资产重组停牌 | 22.09 | 2017年7月14日 | 19.88 | 9,996 | 240,102.28 | 220,811.64 |
| 002168 | 深圳惠程 | 2017年1月23日 | 重大资产重组停牌 | 16.99 | - | - | 12,416 | 161,777.45 | 210,947.84 |
| 002075 | 沙钢股份 | 2016年9月19日 | 重大资产重组停牌 | 16.12 | - | - | 12,900 | 184,316.22 | 207,948.00 |
| 002129 | 中环股份 | 2016年4月25日 | 重大资产重组停牌 | 8.27 | - | - | 24,029 | 370,675.92 | 198,719.83 |
| 002049 | 紫光国芯 | 2017年2月20日 | 重大资产重组停牌 | 30.82 | 2017年7月17日 | 27.74 | 5,861 | 253,275.93 | 180,636.02 |
| 300134 | 大富科技 | 2017年2月9日 | 重大资产重组停牌 | 23.36 | - | - | 6,331 | 175,478.16 | 147,892.16 |
| 002013 | 中航机电 | 2017年5月12日 | 重大资产重组停牌 | 10.33 | 2017年8月2日 | 11.36 | 13,539 | 146,485.38 | 139,857.87 |
| 300367 | 东方网力 | 2016年12月15日 | 重大资产重组停牌 | 20.00 | 2017年7月3日 | 18.01 | 6,900 | 170,420.47 | 138,000.00 |
| 000061 | 农产品 | 2017年6月28日 | 重大资产重组停牌 | 9.06 | - | - | 14,070 | 217,555.69 | 127,474.20 |
| 300267 | 尔康制药 | 2017年5月 | 重大资产重组停牌 | 11.46 | - | - | 10,400 | 165,214.03 | 119,184.00 |

| | | | | | | | | | |
|--------|--------|-----------------|------------------|-------|----------------|-------|--------|------------|------------|
| | | 月 10 日 | 项停牌 | | | | | | |
| 002399 | 海普瑞 | 2017 年 4 月 28 日 | 重大事 项停牌 | 20.23 | - | - | 5,651 | 110,137.99 | 114,319.73 |
| 002642 | 荣之联 | 2017 年 4 月 10 日 | 重大事 项停牌 | 25.06 | 2017 年 7 月 7 日 | 22.54 | 4,478 | 138,636.70 | 112,218.68 |
| 300291 | 华录百纳 | 2017 年 4 月 19 日 | 重大资 产重组 停牌 | 20.02 | - | - | 5,600 | 176,277.06 | 112,112.00 |
| 300085 | 银之杰 | 2017 年 6 月 30 日 | 重大事 项停牌 | 18.50 | 2017 年 7 月 7 日 | 18.88 | 5,420 | 179,782.71 | 100,270.00 |
| 002681 | 奋达科技 | 2017 年 6 月 22 日 | 重大事 项停牌 | 12.59 | 2017 年 7 月 3 日 | 12.70 | 7,654 | 114,602.71 | 96,363.86 |
| 002010 | 传化智联 | 2017 年 6 月 30 日 | 重大事 项停牌 | 15.26 | 2017 年 7 月 4 日 | 16.77 | 5,700 | 105,554.50 | 86,982.00 |
| 002610 | 爱康科技 | 2017 年 5 月 12 日 | 重大事 项停牌 | 2.44 | 2017 年 8 月 2 日 | 2.44 | 29,100 | 94,436.74 | 71,004.00 |
| 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.4 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 2017 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 | 1,488,408.49 | - | - | - | - | - | 1,488,408.49 |
| 结算备付金 | 2,394.43 | - | - | - | - | - | 2,394.43 |
| 存出保证金 | 316.34 | - | - | - | - | - | 316.34 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 91,318,018.48 | 91,318,018.48 |

| | | | | | | | |
|--------------------------|--------------|--------|----------|-------|-------|----------------|---------------|
| 应收利息 | | | | | | 296.34 | 296.34 |
| 其他资产 | | | | | | - | - |
| 资产总计 | 1,491,119.26 | | | | | 91,318,314.82 | 92,809,434.08 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | | | | | | 35,598.77 | 35,598.77 |
| 应付管理人报酬 | | | | | | 32,543.63 | 32,543.63 |
| 应付托管费 | | | | | | 6,508.72 | 6,508.72 |
| 应付交易费用 | | | | | | 13,266.48 | 13,266.48 |
| 其他负债 | | | | | | 329,799.49 | 329,799.49 |
| 负债总计 | | | | | | 417,717.09 | 417,717.09 |
| 利率敏感度缺口 | 1,491,119.26 | | | | | -90,900,597.73 | 92,391,716.99 |
| 上年度末 2016 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 | 665,090.68 | | | | | | 665,090.68 |
| 存出保证金 | 90.87 | | | | | | 90.87 |
| 交易性金融资产 | | | | | | -73,767,312.14 | 73,767,312.14 |
| 应收证券清算款 | | | | | | 351,050.14 | 351,050.14 |
| 应收利息 | | | | | | 133.03 | 133.03 |
| 资产总计 | 665,181.55 | | | | | -74,118,495.31 | 74,783,676.86 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | | | | | | 32,471.99 | 32,471.99 |
| 应付托管费 | | | | | | 6,494.38 | 6,494.38 |
| 应付交易费用 | | | | | | 12,531.98 | 12,531.98 |
| 其他负债 | | | | | | 215,000.00 | 215,000.00 |
| 应付证券清算款 | | | | | | 5,328.55 | 5,328.55 |
| 负债总计 | | | | | | 271,826.90 | 271,826.90 |
| 利率敏感度缺口 | 665,181.55 | | | | | -73,846,668.41 | 74,511,849.96 |

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 2017 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2016 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 | 91,318,018.48 | 98.84 | 73,767,312.14 | 99.00 |
| 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 | 91,318,018.48 | 98.84 | 73,767,312.14 | 99.00 |

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，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 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（2017 年 6 月 30 日） | 上年度末（2016 年 12 月 31 日） |
| | 深证 300 指数上涨 5% | 4,567,727.84 | 3,623,144.41 |
| 深证 300 指数下跌 5% | -4,567,727.84 | -3,623,144.41 | |

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 | 91,318,018.48 | 98.39 |
| | 其中：股票 | 91,318,018.48 | 98.39 |
| 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 | 1,490,802.92 | 1.61 |
| 7 | 其他各项资产 | 612.68 | 0.00 |
| 8 | 合计 | 92,809,434.08 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 2,480,117.29 | 2.68 |
| B | 采矿业 | 992,215.13 | 1.07 |
| C | 制造业 | 55,477,023.86 | 60.05 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 921,829.37 | 1.00 |
| E | 建筑业 | 1,597,093.57 | 1.73 |
| F | 批发和零售业 | 1,856,502.85 | 2.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 337,584.00 | 0.37 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 9,323,299.87 | 10.09 |
| J | 金融业 | 7,160,620.12 | 7.75 |
| K | 房地产业 | 5,028,952.53 | 5.44 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,498,758.03 | 1.62 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,643,866.21 | 1.78 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 759,327.50 | 0.82 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,960,024.25 | 2.12 |
| S | 综合 | 280,803.90 | 0.30 |
| | 合计 | 91,318,018.48 | 98.84 |

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

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 | 000651 | 格力电器 | 85,348 | 3,513,777.16 | 3.80 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 78,707 | 3,387,549.28 | 3.67 |
| 3 | 000725 | 京东方 A | 456,008 | 1,896,993.28 | 2.05 |
| 4 | 002415 | 海康威视 | 57,511 | 1,857,605.30 | 2.01 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 33,168 | 1,846,130.88 | 2.00 |
| 6 | 000002 | 万科 A | 72,798 | 1,817,766.06 | 1.97 |
| 7 | 300498 | 温氏股份 | 68,164 | 1,597,764.16 | 1.73 |
| 8 | 000001 | 平安银行 | 151,321 | 1,420,904.19 | 1.54 |
| 9 | 000063 | 中兴通讯 | 42,883 | 1,018,042.42 | 1.10 |
| 10 | 000776 | 广发证券 | 54,292 | 936,537.00 | 1.01 |
| 11 | 002450 | 康得新 | 41,389 | 932,080.28 | 1.01 |
| 12 | 002304 | 洋河股份 | 10,083 | 875,305.23 | 0.95 |
| 13 | 000538 | 云南白药 | 8,358 | 784,398.30 | 0.85 |
| 14 | 001979 | 招商蛇口 | 35,110 | 749,949.60 | 0.81 |
| 15 | 002230 | 科大讯飞 | 18,090 | 721,791.00 | 0.78 |
| 16 | 002024 | 苏宁云商 | 62,725 | 705,656.25 | 0.76 |
| 17 | 000423 | 东阿阿胶 | 9,300 | 668,577.00 | 0.72 |
| 18 | 002466 | 天齐锂业 | 12,200 | 663,070.00 | 0.72 |
| 19 | 000166 | 申万宏源 | 118,106 | 661,393.60 | 0.72 |
| 20 | 002236 | 大华股份 | 28,545 | 651,111.45 | 0.70 |
| 21 | 002241 | 歌尔股份 | 33,590 | 647,615.20 | 0.70 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|---------|------------|------|
| 22 | 000568 | 泸州老窖 | 12,722 | 643,478.76 | 0.70 |
| 23 | 300059 | 东方财富 | 53,352 | 641,291.04 | 0.69 |
| 24 | 002456 | 欧菲光 | 34,095 | 619,506.15 | 0.67 |
| 25 | 002142 | 宁波银行 | 31,755 | 612,871.50 | 0.66 |
| 26 | 300072 | 三聚环保 | 16,497 | 611,213.85 | 0.66 |
| 27 | 000069 | 华侨城 A | 57,981 | 583,288.86 | 0.63 |
| 28 | 000338 | 潍柴动力 | 42,962 | 567,098.40 | 0.61 |
| 29 | 000413 | 东旭光电 | 50,465 | 566,217.30 | 0.61 |
| 30 | 000783 | 长江证券 | 58,899 | 557,773.53 | 0.60 |
| 31 | 300136 | 信维通信 | 13,900 | 556,278.00 | 0.60 |
| 32 | 000625 | 长安汽车 | 38,481 | 554,896.02 | 0.60 |
| 33 | 300104 | 乐视网 | 17,673 | 542,207.64 | 0.59 |
| 34 | 002008 | 大族激光 | 15,540 | 538,305.60 | 0.58 |
| 35 | 300070 | 碧水源 | 27,321 | 509,536.65 | 0.55 |
| 36 | 002594 | 比亚迪 | 10,193 | 509,140.35 | 0.55 |
| 37 | 002673 | 西部证券 | 34,546 | 491,244.12 | 0.53 |
| 38 | 000839 | 中信国安 | 48,510 | 484,614.90 | 0.52 |
| 39 | 300124 | 汇川技术 | 18,835 | 481,045.90 | 0.52 |
| 40 | 002475 | 立讯精密 | 16,188 | 473,337.12 | 0.51 |
| 41 | 002202 | 金风科技 | 29,683 | 459,196.01 | 0.50 |
| 42 | 002027 | 分众传媒 | 32,000 | 440,320.00 | 0.48 |
| 43 | 000768 | 中航飞机 | 23,820 | 439,240.80 | 0.48 |
| 44 | 300024 | 机器人 | 22,284 | 434,538.00 | 0.47 |
| 45 | 002736 | 国信证券 | 32,775 | 434,268.75 | 0.47 |
| 46 | 000100 | TCL 集团 | 123,915 | 425,028.45 | 0.46 |
| 47 | 000963 | 华东医药 | 8,496 | 422,251.20 | 0.46 |
| 48 | 002085 | 万丰奥威 | 21,640 | 420,898.00 | 0.46 |
| 49 | 002460 | 赣锋锂业 | 9,100 | 420,875.00 | 0.46 |
| 50 | 000895 | 双汇发展 | 17,518 | 416,052.50 | 0.45 |
| 51 | 002739 | 万达电影 | 8,100 | 412,857.00 | 0.45 |
| 52 | 000728 | 国元证券 | 33,606 | 410,665.32 | 0.44 |
| 53 | 300408 | 三环集团 | 19,500 | 409,305.00 | 0.44 |
| 54 | 002572 | 索菲亚 | 9,500 | 389,500.00 | 0.42 |
| 55 | 000157 | 中联重科 | 85,543 | 384,088.07 | 0.42 |
| 56 | 000623 | 吉林敖东 | 16,661 | 381,370.29 | 0.41 |
| 57 | 002508 | 老板电器 | 8,590 | 373,493.20 | 0.40 |
| 58 | 300003 | 乐普医疗 | 16,406 | 362,736.66 | 0.39 |
| 59 | 000661 | 长春高新 | 2,795 | 360,862.45 | 0.39 |
| 60 | 002007 | 华兰生物 | 9,881 | 360,656.50 | 0.39 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|------------|------|
| 61 | 002044 | 美年健康 | 21,100 | 358,700.00 | 0.39 |
| 62 | 000709 | 河钢股份 | 84,200 | 352,798.00 | 0.38 |
| 63 | 002797 | 第一创业 | 38,160 | 351,453.60 | 0.38 |
| 64 | 002271 | 东方雨虹 | 9,400 | 348,740.00 | 0.38 |
| 65 | 000540 | 中天金融 | 50,076 | 348,028.20 | 0.38 |
| 66 | 000793 | 华闻传媒 | 33,718 | 341,226.16 | 0.37 |
| 67 | 002065 | 东华软件 | 15,630 | 340,577.70 | 0.37 |
| 68 | 300156 | 神雾环保 | 10,300 | 337,428.00 | 0.37 |
| 69 | 300017 | 网宿科技 | 27,935 | 337,175.45 | 0.36 |
| 70 | 002310 | 东方园林 | 20,145 | 336,824.40 | 0.36 |
| 71 | 000050 | 深天马 A | 16,303 | 335,352.71 | 0.36 |
| 72 | 000826 | 启迪桑德 | 9,421 | 330,865.52 | 0.36 |
| 73 | 000630 | 铜陵有色 | 114,935 | 326,415.40 | 0.35 |
| 74 | 002558 | 巨人网络 | 6,900 | 318,918.00 | 0.35 |
| 75 | 000060 | 中金岭南 | 28,432 | 318,438.40 | 0.34 |
| 76 | 002405 | 四维图新 | 16,094 | 318,017.44 | 0.34 |
| 77 | 002146 | 荣盛发展 | 32,205 | 317,863.35 | 0.34 |
| 78 | 300315 | 掌趣科技 | 38,808 | 316,673.28 | 0.34 |
| 79 | 002340 | 格林美 | 51,873 | 313,831.65 | 0.34 |
| 80 | 000066 | 中国长城 | 34,436 | 310,268.36 | 0.34 |
| 81 | 000656 | 金科股份 | 47,313 | 309,427.02 | 0.33 |
| 82 | 002465 | 海格通信 | 28,730 | 308,560.20 | 0.33 |
| 83 | 000998 | 隆平高科 | 13,948 | 307,134.96 | 0.33 |
| 84 | 000876 | 新希望 | 37,206 | 305,833.32 | 0.33 |
| 85 | 000425 | 徐工机械 | 79,798 | 299,242.50 | 0.32 |
| 86 | 002500 | 山西证券 | 29,549 | 283,079.42 | 0.31 |
| 87 | 000750 | 国海证券 | 51,284 | 282,062.00 | 0.31 |
| 88 | 000009 | 中国宝安 | 34,710 | 280,803.90 | 0.30 |
| 89 | 000778 | 新兴铸管 | 41,786 | 279,966.20 | 0.30 |
| 90 | 300115 | 长盈精密 | 9,586 | 279,719.48 | 0.30 |
| 91 | 000997 | 新大陆 | 12,210 | 277,044.90 | 0.30 |
| 92 | 000046 | 泛海控股 | 31,618 | 276,025.14 | 0.30 |
| 93 | 002252 | 上海莱士 | 13,613 | 275,527.12 | 0.30 |
| 94 | 002081 | 金螳螂 | 25,022 | 274,741.56 | 0.30 |
| 95 | 000503 | 海虹控股 | 10,950 | 272,983.50 | 0.30 |
| 96 | 002280 | 联络互动 | 24,900 | 270,912.00 | 0.29 |
| 97 | 000559 | 万向钱潮 | 25,368 | 269,408.16 | 0.29 |
| 98 | 000686 | 东北证券 | 26,704 | 268,375.20 | 0.29 |
| 99 | 000039 | 中集集团 | 14,872 | 268,142.16 | 0.29 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 100 | 002074 | 国轩高科 | 8,459 | 266,881.45 | 0.29 |
| 101 | 000581 | 威孚高科 | 10,277 | 266,174.30 | 0.29 |
| 102 | 002092 | 中泰化学 | 20,733 | 263,309.10 | 0.28 |
| 103 | 300296 | 利亚德 | 14,000 | 263,200.00 | 0.28 |
| 104 | 000402 | 金融街 | 22,380 | 262,293.60 | 0.28 |
| 105 | 000792 | 盐湖股份 | 24,914 | 260,351.30 | 0.28 |
| 106 | 300433 | 蓝思科技 | 8,780 | 255,410.20 | 0.28 |
| 107 | 300144 | 宋城演艺 | 12,087 | 252,255.69 | 0.27 |
| 108 | 002195 | 二三四五 | 35,250 | 252,037.50 | 0.27 |
| 109 | 300088 | 长信科技 | 15,974 | 251,590.50 | 0.27 |
| 110 | 000983 | 西山煤电 | 28,570 | 250,558.90 | 0.27 |
| 111 | 000917 | 电广传媒 | 21,973 | 248,294.90 | 0.27 |
| 112 | 002223 | 鱼跃医疗 | 10,426 | 246,887.68 | 0.27 |
| 113 | 300027 | 华谊兄弟 | 30,454 | 246,372.86 | 0.27 |
| 114 | 002294 | 信立泰 | 6,902 | 246,125.32 | 0.27 |
| 115 | 002385 | 大北农 | 39,037 | 245,542.73 | 0.27 |
| 116 | 000786 | 北新建材 | 15,444 | 244,632.96 | 0.26 |
| 117 | 000999 | 华润三九 | 7,612 | 241,681.00 | 0.26 |
| 118 | 000970 | 中科三环 | 16,305 | 240,987.90 | 0.26 |
| 119 | 300033 | 同花顺 | 3,832 | 238,388.72 | 0.26 |
| 120 | 002179 | 中航光电 | 7,608 | 237,293.52 | 0.26 |
| 121 | 002038 | 双鹭药业 | 8,128 | 236,931.20 | 0.26 |
| 122 | 002410 | 广联达 | 12,253 | 230,356.40 | 0.25 |
| 123 | 002183 | 怡亚通 | 26,610 | 229,644.30 | 0.25 |
| 124 | 300383 | 光环新网 | 16,900 | 229,164.00 | 0.25 |
| 125 | 300182 | 捷成股份 | 23,775 | 227,289.00 | 0.25 |
| 126 | 002311 | 海大集团 | 12,294 | 224,611.38 | 0.24 |
| 127 | 000400 | 许继电气 | 12,472 | 223,997.12 | 0.24 |
| 128 | 002426 | 胜利精密 | 29,096 | 223,457.28 | 0.24 |
| 129 | 300015 | 爱尔眼科 | 9,555 | 222,249.30 | 0.24 |
| 130 | 002407 | 多氟多 | 10,100 | 222,099.00 | 0.24 |
| 131 | 002185 | 华天科技 | 30,646 | 221,877.04 | 0.24 |
| 132 | 000008 | 神州高铁 | 30,400 | 221,312.00 | 0.24 |
| 133 | 000887 | 中鼎股份 | 9,996 | 220,811.64 | 0.24 |
| 134 | 002573 | 清新环境 | 11,699 | 220,175.18 | 0.24 |
| 135 | 000961 | 中南建设 | 33,540 | 218,680.80 | 0.24 |
| 136 | 000415 | 渤海金控 | 32,406 | 218,092.38 | 0.24 |
| 137 | 300159 | 新研股份 | 16,300 | 215,812.00 | 0.23 |
| 138 | 000878 | 云南铜业 | 16,323 | 215,300.37 | 0.23 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 139 | 300055 | 万邦达 | 11,679 | 214,893.60 | 0.23 |
| 140 | 000566 | 海南海药 | 16,176 | 214,493.76 | 0.23 |
| 141 | 002422 | 科伦药业 | 12,816 | 211,720.32 | 0.23 |
| 142 | 300197 | 铁汉生态 | 15,900 | 211,152.00 | 0.23 |
| 143 | 002366 | 台海核电 | 4,500 | 211,095.00 | 0.23 |
| 144 | 002168 | 深圳惠程 | 12,416 | 210,947.84 | 0.23 |
| 145 | 000488 | 晨鸣纸业 | 16,200 | 208,980.00 | 0.23 |
| 146 | 002075 | 沙钢股份 | 12,900 | 207,948.00 | 0.23 |
| 147 | 300113 | 顺网科技 | 7,700 | 207,130.00 | 0.22 |
| 148 | 000028 | 国药一致 | 2,555 | 206,699.50 | 0.22 |
| 149 | 002217 | 合力泰 | 20,700 | 204,516.00 | 0.22 |
| 150 | 300058 | 蓝色光标 | 25,948 | 202,913.36 | 0.22 |
| 151 | 002030 | 达安基因 | 9,287 | 202,363.73 | 0.22 |
| 152 | 002470 | 金正大 | 26,784 | 201,683.52 | 0.22 |
| 153 | 300418 | 昆仑万维 | 8,800 | 201,256.00 | 0.22 |
| 154 | 000977 | 浪潮信息 | 11,618 | 201,223.76 | 0.22 |
| 155 | 002129 | 中环股份 | 24,029 | 198,719.83 | 0.22 |
| 156 | 002176 | 江特电机 | 22,700 | 197,944.00 | 0.21 |
| 157 | 000960 | 锡业股份 | 14,525 | 197,685.25 | 0.21 |
| 158 | 002273 | 水晶光电 | 9,466 | 195,283.58 | 0.21 |
| 159 | 002583 | 海能达 | 12,100 | 194,689.00 | 0.21 |
| 160 | 000598 | 兴蓉环境 | 34,393 | 193,288.66 | 0.21 |
| 161 | 300166 | 东方国信 | 14,360 | 192,854.80 | 0.21 |
| 162 | 300168 | 万达信息 | 13,188 | 191,885.40 | 0.21 |
| 163 | 000690 | 宝新能源 | 31,573 | 188,806.54 | 0.20 |
| 164 | 000825 | 太钢不锈 | 43,265 | 188,202.75 | 0.20 |
| 165 | 300146 | 汤臣倍健 | 13,688 | 188,073.12 | 0.20 |
| 166 | 000547 | 航天发展 | 17,833 | 186,354.85 | 0.20 |
| 167 | 300002 | 神州泰岳 | 22,194 | 185,097.96 | 0.20 |
| 168 | 000883 | 湖北能源 | 36,743 | 184,449.86 | 0.20 |
| 169 | 002400 | 省广股份 | 22,912 | 183,983.36 | 0.20 |
| 170 | 002051 | 中工国际 | 8,869 | 183,854.37 | 0.20 |
| 171 | 002004 | 华邦健康 | 23,288 | 182,345.04 | 0.20 |
| 172 | 002138 | 顺络电子 | 9,800 | 182,084.00 | 0.20 |
| 173 | 002049 | 紫光国芯 | 5,861 | 180,636.02 | 0.20 |
| 174 | 300244 | 迪安诊断 | 5,670 | 178,378.20 | 0.19 |
| 175 | 002439 | 启明星辰 | 9,520 | 177,072.00 | 0.19 |
| 176 | 000671 | 阳光城 | 30,405 | 176,957.10 | 0.19 |
| 177 | 002001 | 新和成 | 9,108 | 176,786.28 | 0.19 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 178 | 000078 | 海王生物 | 29,242 | 176,329.26 | 0.19 |
| 179 | 000930 | 中粮生化 | 16,200 | 174,636.00 | 0.19 |
| 180 | 002108 | 沧州明珠 | 13,080 | 174,618.00 | 0.19 |
| 181 | 000988 | 华工科技 | 11,946 | 174,292.14 | 0.19 |
| 182 | 002343 | 慈文传媒 | 4,600 | 174,156.00 | 0.19 |
| 183 | 002131 | 利欧股份 | 52,900 | 174,041.00 | 0.19 |
| 184 | 002019 | 亿帆医药 | 10,400 | 173,472.00 | 0.19 |
| 185 | 002292 | 奥飞娱乐 | 10,224 | 172,785.60 | 0.19 |
| 186 | 000938 | 紫光股份 | 2,800 | 171,136.00 | 0.19 |
| 187 | 000697 | 炼石有色 | 8,291 | 169,716.77 | 0.18 |
| 188 | 002491 | 通鼎互联 | 12,600 | 169,344.00 | 0.18 |
| 189 | 002714 | 牧原股份 | 6,200 | 168,764.00 | 0.18 |
| 190 | 002250 | 联化科技 | 11,787 | 168,554.10 | 0.18 |
| 191 | 000738 | 航发控制 | 8,548 | 167,284.36 | 0.18 |
| 192 | 000059 | 华锦股份 | 16,600 | 166,166.00 | 0.18 |
| 193 | 000627 | 天茂集团 | 20,416 | 164,961.28 | 0.18 |
| 194 | 000800 | 一汽轿车 | 16,217 | 164,926.89 | 0.18 |
| 195 | 000806 | 银河生物 | 12,200 | 164,700.00 | 0.18 |
| 196 | 002444 | 巨星科技 | 10,500 | 163,590.00 | 0.18 |
| 197 | 000758 | 中色股份 | 23,116 | 162,043.16 | 0.18 |
| 198 | 002408 | 齐翔腾达 | 14,600 | 161,768.00 | 0.18 |
| 199 | 000718 | 苏宁环球 | 27,511 | 161,214.46 | 0.17 |
| 200 | 002624 | 完美世界 | 4,700 | 161,210.00 | 0.17 |
| 201 | 002555 | 三七互娱 | 6,300 | 161,091.00 | 0.17 |
| 202 | 000732 | 泰禾集团 | 9,600 | 160,128.00 | 0.17 |
| 203 | 000729 | 燕京啤酒 | 23,676 | 159,102.72 | 0.17 |
| 204 | 300077 | 国民技术 | 11,576 | 158,475.44 | 0.17 |
| 205 | 002424 | 贵州百灵 | 8,361 | 157,688.46 | 0.17 |
| 206 | 300253 | 卫宁健康 | 20,124 | 157,168.44 | 0.17 |
| 207 | 002431 | 棕榈股份 | 14,242 | 156,946.84 | 0.17 |
| 208 | 000516 | 国际医学 | 28,092 | 156,472.44 | 0.17 |
| 209 | 300014 | 亿纬锂能 | 8,585 | 155,817.75 | 0.17 |
| 210 | 000006 | 深振业 A | 17,634 | 155,355.54 | 0.17 |
| 211 | 002601 | 龙蟠佰利 | 9,400 | 153,972.00 | 0.17 |
| 212 | 002191 | 劲嘉股份 | 16,239 | 151,997.04 | 0.16 |
| 213 | 000592 | 平潭发展 | 27,434 | 151,435.68 | 0.16 |
| 214 | 002501 | 利源精制 | 13,296 | 151,175.52 | 0.16 |
| 215 | 000898 | 鞍钢股份 | 26,654 | 150,861.64 | 0.16 |
| 216 | 002701 | 奥瑞金 | 23,572 | 150,625.08 | 0.16 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 217 | 000012 | 南玻 A | 16,088 | 150,101.04 | 0.16 |
| 218 | 002665 | 首航节能 | 20,740 | 149,328.00 | 0.16 |
| 219 | 300134 | 大富科技 | 6,331 | 147,892.16 | 0.16 |
| 220 | 000031 | 中粮地产 | 19,606 | 147,633.18 | 0.16 |
| 221 | 300133 | 华策影视 | 13,110 | 146,832.00 | 0.16 |
| 222 | 000979 | 中弘股份 | 55,844 | 146,311.28 | 0.16 |
| 223 | 002389 | 南洋科技 | 6,900 | 145,314.00 | 0.16 |
| 224 | 000712 | 锦龙股份 | 8,853 | 144,923.61 | 0.16 |
| 225 | 300090 | 盛运环保 | 15,200 | 143,944.00 | 0.16 |
| 226 | 300207 | 欣旺达 | 12,200 | 143,838.00 | 0.16 |
| 227 | 002353 | 杰瑞股份 | 9,011 | 142,554.02 | 0.15 |
| 228 | 000027 | 深圳能源 | 21,169 | 142,467.37 | 0.15 |
| 229 | 300068 | 南都电源 | 8,400 | 141,456.00 | 0.15 |
| 230 | 300251 | 光线传媒 | 17,206 | 140,917.14 | 0.15 |
| 231 | 000563 | 陕国投 A | 27,100 | 140,107.00 | 0.15 |
| 232 | 002013 | 中航机电 | 13,539 | 139,857.87 | 0.15 |
| 233 | 002352 | 顺丰控股 | 2,600 | 138,216.00 | 0.15 |
| 234 | 300367 | 东方网力 | 6,900 | 138,000.00 | 0.15 |
| 235 | 002477 | 雏鹰农牧 | 31,052 | 137,560.36 | 0.15 |
| 236 | 300001 | 特锐德 | 8,200 | 137,432.00 | 0.15 |
| 237 | 002002 | 鸿达兴业 | 17,514 | 137,134.62 | 0.15 |
| 238 | 300026 | 红日药业 | 29,036 | 136,759.56 | 0.15 |
| 239 | 002153 | 石基信息 | 5,938 | 134,970.74 | 0.15 |
| 240 | 002506 | 协鑫集成 | 29,400 | 134,946.00 | 0.15 |
| 241 | 002493 | 荣盛石化 | 13,800 | 134,688.00 | 0.15 |
| 242 | 000156 | 华数传媒 | 8,940 | 133,295.40 | 0.14 |
| 243 | 002522 | 浙江众成 | 8,100 | 132,435.00 | 0.14 |
| 244 | 000829 | 天音控股 | 12,144 | 131,155.20 | 0.14 |
| 245 | 002411 | 必康股份 | 4,500 | 130,140.00 | 0.14 |
| 246 | 002268 | 卫士通 | 7,720 | 129,850.40 | 0.14 |
| 247 | 300199 | 翰宇药业 | 8,400 | 128,856.00 | 0.14 |
| 248 | 000061 | 农产品 | 14,070 | 127,474.20 | 0.14 |
| 249 | 000807 | 云铝股份 | 17,600 | 127,072.00 | 0.14 |
| 250 | 002643 | 万润股份 | 8,600 | 126,936.00 | 0.14 |
| 251 | 002602 | 世纪华通 | 3,500 | 126,910.00 | 0.14 |
| 252 | 000685 | 中山公用 | 11,563 | 126,614.85 | 0.14 |
| 253 | 300020 | 银江股份 | 9,100 | 125,944.00 | 0.14 |
| 254 | 000687 | 华讯方舟 | 8,269 | 125,192.66 | 0.14 |
| 255 | 002390 | 信邦制药 | 14,300 | 124,553.00 | 0.13 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 256 | 000937 | 冀中能源 | 20,190 | 123,562.80 | 0.13 |
| 257 | 002709 | 天赐材料 | 3,000 | 123,510.00 | 0.13 |
| 258 | 002368 | 太极股份 | 4,420 | 122,389.80 | 0.13 |
| 259 | 002468 | 申通快递 | 4,800 | 121,968.00 | 0.13 |
| 260 | 002018 | 华信国际 | 17,800 | 121,930.00 | 0.13 |
| 261 | 002489 | 浙江永强 | 18,700 | 119,306.00 | 0.13 |
| 262 | 300267 | 尔康制药 | 10,400 | 119,184.00 | 0.13 |
| 263 | 002155 | 湖南黄金 | 12,300 | 117,711.00 | 0.13 |
| 264 | 002299 | 圣农发展 | 7,899 | 117,458.13 | 0.13 |
| 265 | 002276 | 万马股份 | 11,600 | 117,044.00 | 0.13 |
| 266 | 002657 | 中科金财 | 4,032 | 116,887.68 | 0.13 |
| 267 | 002716 | 金贵银业 | 6,000 | 115,140.00 | 0.12 |
| 268 | 002326 | 永太科技 | 8,300 | 115,038.00 | 0.12 |
| 269 | 300273 | 和佳股份 | 9,458 | 115,009.28 | 0.12 |
| 270 | 002399 | 海普瑞 | 5,651 | 114,319.73 | 0.12 |
| 271 | 000762 | 西藏矿业 | 8,000 | 113,360.00 | 0.12 |
| 272 | 300073 | 当升科技 | 4,500 | 112,230.00 | 0.12 |
| 273 | 002642 | 荣之联 | 4,478 | 112,218.68 | 0.12 |
| 274 | 300291 | 华录百纳 | 5,600 | 112,112.00 | 0.12 |
| 275 | 000901 | 航天科技 | 4,102 | 111,410.32 | 0.12 |
| 276 | 300496 | 中科创达 | 3,900 | 110,370.00 | 0.12 |
| 277 | 300431 | 暴风集团 | 4,620 | 110,094.60 | 0.12 |
| 278 | 002152 | 广电运通 | 12,810 | 106,451.10 | 0.12 |
| 279 | 002437 | 誉衡药业 | 14,398 | 104,817.44 | 0.11 |
| 280 | 300010 | 立思辰 | 8,000 | 103,600.00 | 0.11 |
| 281 | 000519 | 中兵红箭 | 8,200 | 103,320.00 | 0.11 |
| 282 | 300085 | 银之杰 | 5,420 | 100,270.00 | 0.11 |
| 283 | 002681 | 奋达科技 | 7,654 | 96,363.86 | 0.10 |
| 284 | 000062 | 深圳华强 | 3,631 | 96,330.43 | 0.10 |
| 285 | 300376 | 易事特 | 10,300 | 93,421.00 | 0.10 |
| 286 | 000957 | 中通客车 | 7,700 | 90,090.00 | 0.10 |
| 287 | 000617 | 中油资本 | 5,700 | 88,920.00 | 0.10 |
| 288 | 000959 | 首钢股份 | 12,600 | 88,074.00 | 0.10 |
| 289 | 300292 | 吴通控股 | 13,000 | 88,010.00 | 0.10 |
| 290 | 002010 | 传化智联 | 5,700 | 86,982.00 | 0.09 |
| 291 | 000539 | 粤电力 A | 16,173 | 86,202.09 | 0.09 |
| 292 | 002329 | 皇氏集团 | 8,900 | 85,529.00 | 0.09 |
| 293 | 002563 | 森马服饰 | 9,600 | 81,408.00 | 0.09 |
| 294 | 000555 | 神州信息 | 4,800 | 80,160.00 | 0.09 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|--------|-----------|------|
| 295 | 002120 | 韵达股份 | 1,500 | 77,400.00 | 0.08 |
| 296 | 002610 | 爱康科技 | 29,100 | 71,004.00 | 0.08 |
| 297 | 002631 | 德尔未来 | 4,500 | 66,285.00 | 0.07 |
| 298 | 002831 | 裕同科技 | 800 | 60,000.00 | 0.06 |
| 299 | 000564 | 供销大集 | 8,900 | 57,939.00 | 0.06 |
| 300 | 000693 | *ST 华泽 | 4,421 | 55,262.50 | 0.06 |
| 301 | 300474 | 景嘉微 | 1,400 | 49,560.00 | 0.05 |

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 | 002271 | 东方雨虹 | 349,256.00 | 0.47 |
| 2 | 002558 | 巨人网络 | 317,661.00 | 0.43 |
| 3 | 002797 | 第一创业 | 283,238.80 | 0.38 |
| 4 | 300159 | 新研股份 | 215,181.00 | 0.29 |
| 5 | 300197 | 铁汉生态 | 210,767.00 | 0.28 |
| 6 | 002366 | 台海核电 | 210,189.00 | 0.28 |
| 7 | 000488 | 晨鸣纸业 | 208,862.00 | 0.28 |
| 8 | 002217 | 合力泰 | 203,174.00 | 0.27 |
| 9 | 002027 | 分众传媒 | 200,419.85 | 0.27 |
| 10 | 002583 | 海能达 | 191,879.00 | 0.26 |
| 11 | 002280 | 联络互动 | 179,793.00 | 0.24 |
| 12 | 000059 | 华锦股份 | 166,084.00 | 0.22 |
| 13 | 000806 | 银河生物 | 164,394.00 | 0.22 |
| 14 | 002408 | 齐翔腾达 | 164,100.00 | 0.22 |
| 15 | 300113 | 顺网科技 | 157,110.00 | 0.21 |
| 16 | 002601 | 龙鳞佰利 | 153,893.00 | 0.21 |
| 17 | 002389 | 南洋科技 | 146,202.00 | 0.20 |
| 18 | 300090 | 盛运环保 | 144,476.00 | 0.19 |
| 19 | 000563 | 陕国投 A | 140,107.00 | 0.19 |
| 20 | 002352 | 顺丰控股 | 138,586.00 | 0.19 |

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 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|-----------------|
| 1 | 000333 | 美的集团 | 237,820.00 | 0.32 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 187,171.00 | 0.25 |
| 3 | 300274 | 阳光电源 | 149,147.99 | 0.20 |
| 4 | 300079 | 数码视讯 | 142,513.70 | 0.19 |
| 5 | 000158 | 常山股份 | 140,672.00 | 0.19 |
| 6 | 002266 | 浙富控股 | 139,718.53 | 0.19 |
| 7 | 002022 | 科华生物 | 137,844.70 | 0.18 |
| 8 | 002261 | 拓维信息 | 137,653.00 | 0.18 |
| 9 | 000667 | 美好置业 | 133,344.80 | 0.18 |
| 10 | 002104 | 恒宝股份 | 132,655.35 | 0.18 |
| 11 | 002285 | 世联行 | 130,182.78 | 0.17 |
| 12 | 000021 | 深科技 | 128,215.46 | 0.17 |
| 13 | 300170 | 汉得信息 | 127,997.14 | 0.17 |
| 14 | 300216 | 千山药机 | 125,106.00 | 0.17 |
| 15 | 000543 | 皖能电力 | 120,528.40 | 0.16 |
| 16 | 000002 | 万科 A | 118,617.00 | 0.16 |
| 17 | 002375 | 亚厦股份 | 117,615.76 | 0.16 |
| 18 | 000973 | 佛塑科技 | 115,699.00 | 0.16 |
| 19 | 002055 | 得润电子 | 112,806.76 | 0.15 |
| 20 | 002308 | 威创股份 | 111,208.00 | 0.15 |

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 | 8,666,849.84 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 7,603,029.90 |

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

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

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

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 | 316.34 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 296.34 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 612.68 |

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

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。

§ 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 |
| 1,749 | 39,307.60 | 55,987,433.00 | 81.44% | 12,761,558.00 | 18.56% |

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 | 55,014,142.00 | 80.02% |

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 | 北京无限立通通讯技术有限公 司 | 708,499.00 | 1.03% |
| 2 | 苗桂玲 | 700,000.00 | 1.02% |
| 3 | 杨卓兴 | 489,903.00 | 0.71% |
| 4 | 沈东来 | 404,814.00 | 0.59% |
| 5 | 凌蔚盈 | 390,000.00 | 0.57% |
| 6 | 何凤珍 | 327,200.00 | 0.48% |
| 7 | 钟寿高 | 246,300.00 | 0.36% |
| 8 | 苏州市城市建设开发有限公司 | 244,792.00 | 0.36% |
| 9 | 伞国颖 | 234,000.00 | 0.34% |
| 10 | 卓上智 | 209,600.00 | 0.30% |
| 11 | 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 券投资基金联接基金 | 55,014,142.00 | 80.02% |

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 | 59,148,991.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 16,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 6,400,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 68,748,991.00 |

§ 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. 《汇添富全球移动互联网灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日正式生效，韩贤旺先生任该基金的基金经理。
2. 基金管理人于 2017 年 2 月 4 日公告，增聘欧阳沁春先生和杨璿先生担任汇添富全球移动互联网灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与韩贤旺先生共同管理该基金。
3. 《汇添富鑫利债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 13 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。
4. 基金管理人于 2017 年 3 月 10 日公告，李骁先生任基金管理人副总经理。
5. 《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 15 日正式生效，顾耀强先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。
6. 基金管理人于 2017 年 3 月 16 日公告，增聘吴江宏先生担任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理，与顾耀强先生共同管理该基金。
7. 《汇添富中国高端制造股票型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 20 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。
8. 《汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 14 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。
9. 《汇添富精选美元债债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，何旻先生和高欣先生任该基金的基金经理。
10. 《汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
11. 《汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
12. 《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 15 日正式生效，曾刚先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
13. 基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，聘任郑慧莲女士为汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金和汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。
14. 基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理该基金。
15. 基金管理人 2017 年 6 月 21 日公告，雷鸣先生不再担任汇添富新兴消费股票型证券投资基金的基金经理，由刘伟林先生单独管理该基金。
16. 《汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 6 月 23 日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
17. 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、基金财产的诉讼事项。
本报告期，无涉及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及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。
本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 | 15,775,534.34 | 100.00% | 14,376.02 | 100.00% | - |
| 东北证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民族证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 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 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰联合证 券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证 券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 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 | 3 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | 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 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民族证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰联合证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - | - |
| 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。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 2 个交易单元：太平洋证券（上交所交易单元和深交所交易单元）

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 2016 年年度资产净值的公告 | 公司网站 | 2017 年 1 月 3 日 |
| 2 | 汇添富旗下公募基金 2016 年第 4 季度报告 | 中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2017 年 1 月 19 日 |
| 3 | 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) | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2017 年 3 月 10 日 |
| 4 | 汇添富旗下公募基金 2016 年年度报告及摘要 | 中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2017 年 3 月 29 日 |
| 5 | 汇添富旗下公募基金 2017 年一季报 | 中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2017 年 4 月 24 日 |
| 6 | 深证 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2017 年第 1 号) | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2017 年 4 月 28 日 |
| 7 | 汇添富基金管理股份有限公司关于深证 300 交易型开放式指数证券投资基金增加华泰证券为申购赎 | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2017 年 6 月 2 日 |

| | | | |
|---|---|----------------------|-----------------|
| | 回代理券商的公告 | | |
| 8 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加东亚银行开展的费率优惠活动的公告 | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2017 年 6 月 23 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|---------------------------------|---------------|---------------|--------------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | - | - | - | - | - | - | - |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 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券投资基金联接基金 | 1 | 2017 年 1 月 1 日到 2017 年 6 月 30 日 | 43,814,142.00 | 14,400,000.00 | 3,200,000.00 | 55,014,142.00 | 80.02% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p> | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 无 |
|---|

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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

12.3 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

2017 年 8 月 26 日