

深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 06 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：2020 年 08 月 28 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。本中期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 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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 2020 年 01 月 01 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	5
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	6
§ 4 管理人报告	7
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 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	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
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	57

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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情况.....	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录.....	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 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 09 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（份）	65,548,991.00
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 年 11 月 24 日

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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95588
传真	021-28932998	010-66105798
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 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 20 楼	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	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
----------------	--------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

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(2020年01月01日 - 2020年06月30日)
本期已实现收益	9,341,741.52
本期利润	16,819,264.09
加权平均基金份额本期利润	0.2126
本期加权平均净值利润率	14.76%
本期基金份额净值增长率	15.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)
期末可供分配利润	31,945,380.73
期末可供分配基金份额利润	0.4874
期末基金资产净值	105,408,109.39
期末基金份额净值	1.6081
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)
基金份额累计净值增长率	60.81%

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

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（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

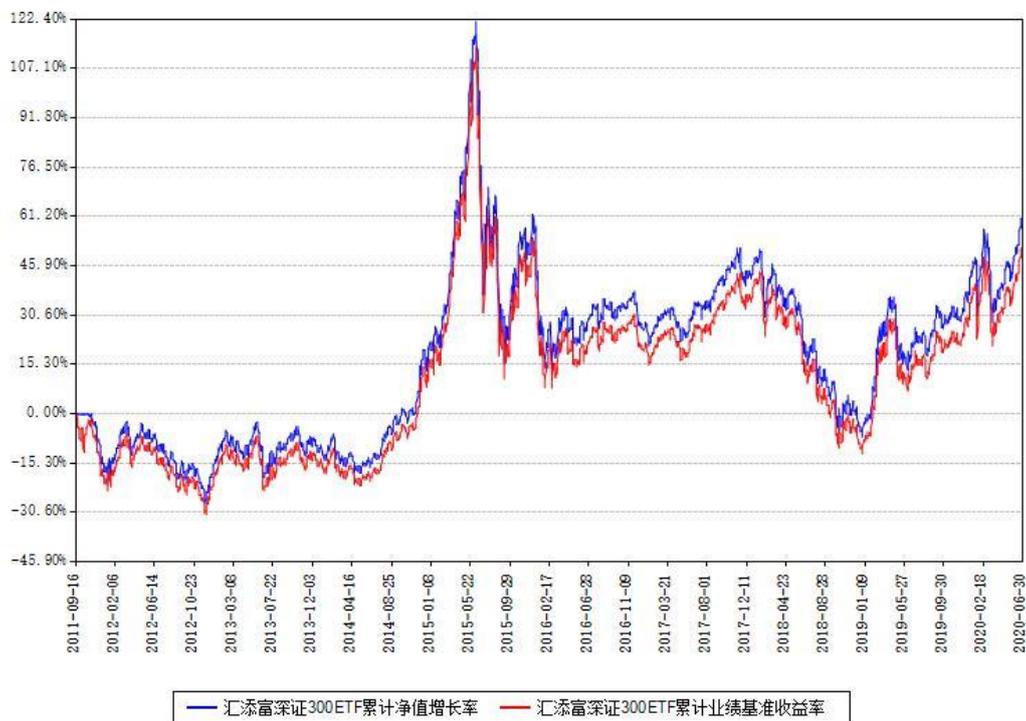
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去一个月	12.21%	0.98%	11.83%	1.00%	0.38%	-0.02%
过去三个月	21.37%	1.10%	20.88%	1.12%	0.49%	-0.02%
过去六个月	15.20%	1.81%	14.95%	1.82%	0.25%	-0.01%
过去一年	32.08%	1.46%	31.85%	1.47%	0.23%	-0.01%
过去三年	19.66%	1.46%	18.77%	1.47%	0.89%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	60.81%	1.59%	51.47%	1.62%	9.34%	-0.03%

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累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011年09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。目前，公司注册资本为 132,724,224 元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2020 上半年，汇添富基金新成立 11 只公开募集证券投资基金，包括 4 只债券型基金、5 只混合型基金、1 只基金中基金、1 只指数基金联接基金。截至 2020 年 6 月 30 日，公司共管理 154 只公开募集证券投资基金，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。

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（年）	说明
		任职日期	离任日期		
赖中立	本基金的基金经理	2015 年 01 月 06 日		13	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

				<p>年 11 月 1 日至今任汇添富黄金及贵金属基金 (LOF) 的基金经理, 2014 年 3 月 6 日至今任汇添富恒生指数分级 (QDII) 基金的基金经理, 2015 年 1 月 6 日至今任汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理, 2015 年 5 月 26 日至 2016 年 7 月 13 日任汇添富香港优势混合基金的基金经理, 2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证环境治理指数 (LOF) 基金的基金经理, 2017 年 5 月 18 日至今任汇添富优选回报混合基金的基金经理, 2017 年 11 月 24 日至今任汇添富中证港股通高股息投资指数 (LOF) 基金的基金经理。</p>
过蓓蓓	本基金的基金经理	2015 年 08 月 18 日	9	<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</p>

				<p>基金经理助理，2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费 ETF 基金、中证医药卫生 ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金、汇添富中证主要消费 ETF 联接基金的基金经理，2015 年 8 月 18 日至今任汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理，2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技指数（LOF）基金的基金经理，2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证中药指数（LOF）基金的基金经理，2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）基金的基金经理，2018 年 10 月 23 日至今任中证银行 ETF 基金的基金经理，2019 年 3 月 26 日至今任添富中证医药 ETF 联接基金的基金经理，2019 年 4 月 15 日至今任添富中证银行 ETF 联接基金的基金经理，2019 年 10 月 8 日至今任添富中证 800ETF 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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:本报告期末本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《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。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作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。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、营运、风险管理以及合规稽核等相关部门组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风控管控,确保公平交易制度的执行和实现。

对于同向交易,我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下(日内、3日内和5日内)同买或者同卖同一证券时两者买卖均价存在的差异(即价差率)序列,然后按两两组合归类计算平均价差率。根据95%置信区间下平均价差率的T检验显著程度、同向交易占优比等方面进行综合分析,来判断是否存在重大利益输送的可能性。本报告期内,未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

对于反向交易,我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析,未发现异常情况。

综合而言,本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,严格执行了公平交易制度,公平对待了旗下各投资组合。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内,本公司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成交量的 5%的情况有 34 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2020 年上半年股票市场起伏，波动性较 2019 年有所提高。一季度全球股市普遍下跌，其主要因素为突发公共卫生事件以及石油价格剧烈波动，导致市场风险偏好下降，美国出现流动性风险，海外市场波动性显著提升，国内股市同样受到剧烈冲击，成长类资产大幅下跌。二季度全球股市企稳反弹，海外流动性风险缓解，国内市场也普遍上涨。

国内对于疫情控制效果相对全球其他国家来说要好，为国内复工复产提供了坚实的基础。复工之前，2 月份国内 PPI 同比下降 0.4%，社会消费品零售同比大幅下降，工业品出现短时间的通缩情况。3 月复工后，国内疫情缓解，居民生活逐渐向正常状态恢复，复工率、发电煤耗等指标指向工业、投资回升，经济重回正轨。4 月社会消费品零售同比恢复较快，尤其是食品项等主要消费板块出现明显的报复性消费的迹象。二季度末，虽然疫情在国内部分地区出现反复，但不影响全局复苏态势，货币政策边际并未有更大宽松，财政政策接力，社融整体向好。

外围市场，以美国为代表的海外国家向市场注入巨大的流动性。在海外疫情并未出现明显抑制的态势的背景下重启经济显示出海外经济也承担了巨大的压力，疫情反复也将对经济复苏形成扰动。海外经济数据改善力度远小于中国。

A 股市场上半年结构性行情特征明显，医药生物行业、主要消费行业是热点，尤其是医药行业估值达到历史较高位置，机构持仓对医药行业的配置比例较 2019 年提升。这在一定程度上体现了经济弱复苏、疫情有反复的背景下，投资者防御性的投资偏好。

深证 300 指数在电子、医药生物、计算机、家用电器等成长性板块配置比例接近 50%，今年上半年上涨 14.95%。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

本基金本报告期基金份额净值增长率为 15.20%。同期业绩比较基准收益率为 14.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

疫情仍在全球范围内持续，部分国家尚未出现明显控制的迹象，因此疫情仍将是下半年最大的不确定性因素，有可能扰动市场风险偏好和资金面。与此同时，全球新冠疫苗研发提速，多款疫苗将在下半年进入三期临床，预期将是缓解疫情影响的重要手段。如果疫情得以控制，海外的大宽松将有可能结束，带来资金溢出效应的减弱。A股市场已经部分融入全球资本市场，因此海外资金的流动也将影响A股市场的流动性。同时，下半年国内货币政策预期仍将保持稳健，边际宽松可能性很低，而财政宽松主要利好基建项目。因此，如果疫苗研发进展喜人、全球流动性收缩，对于上半年防御性、科技成长性板块造成一定的压力，低估值板块或有机会修复估值。

不论短期扰动如何，从中长期来看，A股市场依然是全球最具投资价值的新兴市场，科创板、创业板将继续吸引大批优秀企业上市。

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《中国证监会关于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。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

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

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

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以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的。

本基金本报告期内未进行收益分配。

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 托管人对中期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 2020 年中期报告中财务指标、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：2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	728,492.74	431,865.49
结算备付金		-	-
存出保证金		1,182.45	169.74
交易性金融资产	6.4.7.2	104,878,996.91	120,400,060.91
其中：股票投资		104,827,596.91	120,341,660.91
基金投资		-	-
债券投资		51,400.00	58,400.00
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	69.80	92.98
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		105,608,741.90	120,832,189.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		42,833.14	50,786.78
应付托管费		8,566.63	10,157.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	11,538.12	13,136.31
应交税费		0.21	0.16
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	137,694.41	225,000.00
负债合计		200,632.51	299,080.61
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	65,548,991.00	86,348,991.00
未分配利润	6.4.7.1	39,859,118.39	34,184,117.51

	0		
所有者权益合计		105,408,109.39	120,533,108.51
负债和所有者权益总计		105,608,741.90	120,832,189.12

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6081 元，基金份额总额 65,548,991.00 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：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 01 月 01 日 至 2020 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
一、收入		17,398,105.07	20,531,585.37
1. 利息收入		2,494.75	5,069.70
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,414.13	5,010.05
债券利息收入		80.62	59.65
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,911,643.75	-2,464,721.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,949,394.45	-3,501,984.53
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	82,826.31	37,677.63
资产支持证券投资	6.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	879,422.99	999,585.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,477,522.57	22,936,577.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	6,444.00	54,659.76
减：二、费用		578,840.98	575,817.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	284,486.05	254,027.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	56,897.21	50,805.60
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	24,639.12	30,342.58
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 税金及附加		0.19	0.02
7. 其他费用	6.4.7.21	212,818.41	240,642.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,819,264.09	19,955,767.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,819,264.09	19,955,767.69

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：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 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）	86,348,991.00	34,184,117.51	120,533,108.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,819,264.09	16,819,264.09
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）	-20,800,000.00	-11,144,263.21	-31,944,263.21
其中：1. 基金申购款	14,400,000.00	5,128,825.04	19,528,825.04
2. 基金赎回款	-35,200,000.00	-16,273,088.25	-51,473,088.25
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）	65,548,991.00	39,859,118.39	105,408,109.39
项目	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 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）	76,748,991.00	-4,085,832.07	72,663,158.93

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,955,767.69	19,955,767.69
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）	17,600,000.00	4,646,758.36	22,246,758.36
其中：1. 基金申购款	46,400,000.00	10,035,019.37	56,435,019.37
2. 基金赎回款	-28,800,000.00	-5,388,261.01	-34,188,261.01
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）	94,348,991.00	20,516,693.98	114,865,684.98

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。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、股权期货、资

产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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。本基金紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金业绩比较基准为:深证 300 指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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<年度报告和中期报告>》、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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日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 增值税

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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 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。

6.4.6.5 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 2020 年 06 月 30 日
活期存款	728,492.74
定期存款	-

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	728,492.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 06 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	80,201,837.27	104,827,596.91	24,625,759.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	51,400.00	51,400.00
	银行间市场	-	-
	其他	-	-
	合计	51,400.00	51,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	80,253,237.27	104,878,996.91	24,625,759.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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 2020 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	64.22
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	0.40
应收债券利息	4.73
应收资产支持证券利息	-
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	-

应收出借证券利息	-
其他	0.45
合计	69.80

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	11,538.12
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,538.12

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付审计费	29,835.26
应付信息披露费	59,672.34
应付指数使用费	48,186.81
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
其他	-
合计	137,694.41

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	86,348,991.00	86,348,991.00
本期申购	14,400,000.00	14,400,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-35,200,000.00	-35,200,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	65,548,991.00	65,548,991.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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	31,267,486.51	2,916,631.00	34,184,117.51
本期利润	9,341,741.52	7,477,522.57	16,819,264.09
本期基金份额交易产生的变动数	-8,663,847.30	-2,480,415.91	-11,144,263.21
其中：基金申购款	5,815,117.80	-686,292.76	5,128,825.04
基金赎回款	-14,478,965.10	-1,794,123.15	-16,273,088.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,945,380.73	7,913,737.66	39,859,118.39

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	2,294.17
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	113.99
其他	5.97
合计	2,414.13

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,019,484.97
股票投资收益——赎回差价收入	7,929,909.48
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	8,949,394.45

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
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	8,529,842.39
减：卖出股票成本总额	7,510,357.42
买卖股票差价收入	1,019,484.97

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
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	51,473,088.25
减：现金支付赎回款总额	1,860,071.25
减：赎回股票成本总额	41,683,107.52
赎回差价收入	7,929,909.48

6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	334,210.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	251,300.00
减：应收利息总额	84.54
买卖债券差价收入	82,826.31

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	879,422.99
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	879,422.99

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	7,477,522.57
——股票投资	7,477,522.57
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	7,477,522.57

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	6,444.00
其他	-
合计	6,444.00

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	24,639.12
银行间市场交易费用	-
合计	24,639.12

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	124.00
指数使用费	123,186.81
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	212,818.41

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

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 (“工商银行”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 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	16,095,842.15	100.00	20,892,002.15	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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 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	334,210.85	100.00	332,727.94	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 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	14,668.21	100.00	11,538.12	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 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	19,039.08	100.00	16,901.43	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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	284,486.05	254,027.44
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。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。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
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	56,897.21	50,805.60

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，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末不存在与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末不存在与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券

出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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：本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	728,492.74	2,294.17	902,200.91	4,622.21

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 06 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

				型						
002500	山西 证券 券	2020 年06 月29 日	2020 年07 月10 日	配 股 流 通 受 限	5.00	6.54	6,435	32,175.00	42,084.90	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代 码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	可 流 通 日	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
128114	正 邦 转 债	2020 年06 月17 日	2020 年07 月15 日	新 债 流 通 受 限	100.00	100.00	114	11,400.00	11,400.00	
128112	歌 尔 转 2	2020 年06 月12 日	2020 年07 月13 日	新 债 流 通 受 限	100.00	100.00	400	40,000.00	40,000.00	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

注：截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

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。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系,审慎评估各类资产的流动性,针对性制定流动性风险管理措施,对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配,确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券均在证券交易所上市;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,本报告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。

本报告期内,本基金未发生重大流动性风险事件。

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、结算备付金、结算保证金、债券投资、买入返售金融资产及部分应收申购款等。本基金的生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期	1 个月以内	1-3	3 个月-1 年	1-5	5	不计息	合计
----	--------	-----	----------	-----	---	-----	----

末 2020 年 06 月 30 日		个 月		年	年 以 上		
资产							
银行存款	728,492.74	-	-	-	-	-	728,492.74
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	1,182.45	-	-	-	-	-	1,182.45
交易性金融资产	-	-	51,400.00	-	-	104,827,596.91	104,878,996.91
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	69.80	69.80
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收	-	-	-	-	-	-	-

证券清算款							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	729,675.19	-	51,400.00	-	-	104,827,666.71	105,608,741.90
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	42,833.14	42,833.14
应付托管费	-	-	-	-	-	8,566.63	8,566.63
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
款							
应付							
销售							
服务							
费	-	-	-	-	-	-	-
应付							
交易	-	-	-	-	-	11,538.12	11,538.12
费用							
应交							
税费	-	-	-	-	-	0.21	0.21
应付							
利息	-	-	-	-	-	-	-
应付							
利润	-	-	-	-	-	-	-
其他							
负债	-	-	-	-	-	137,694.41	137,694.41
负债							
总计	-	-	-	-	-	200,632.51	200,632.51
利率							
敏感							
度缺							
口	729,675.19	-	51,400.00	-	-	104,627,034.20	105,408,109.39
上年							
度末							
2019							
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	431,865.49	-	-	-	-	-	431,865.49
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	169.74	-	-	-	-	-	169.74
交易性金融资产	-	-	58,400.00	-	-	120,341,660.91	120,400,060.91
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	92.98	92.98
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
买入返售	-	-	-	-	-	-	-

金融资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	432,035.23	-	58,400.00	-	-	120,341,753.89	120,832,189.12
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	50,786.78	50,786.78
应付托管费	-	-	-	-	-	10,157.36	10,157.36
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务	-	-	-	-	-	-	-

费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	13,136.31	13,136.31
应交税费	-	-	-	-	-	0.16	0.16
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	225,000.00	225,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	299,080.61	299,080.61
利率敏感度缺口	432,035.23	-	58,400.00	-	-	120,042,673.28	120,533,108.51

注:上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值,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:本基金持有的可转债的市场风险在附注 6.4.13.4.3.1 中进行披露;除此之外,本基金本报告期及上年度末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款,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

注:本基金所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 06 月 30 日		上年度末 2019 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	104,827,596.91	99.45	120,341,660.91	99.84
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	51,400.00	0.05	58,400.00	0.05
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	104,878,996.91	99.50	120,400,060.91	99.89

注：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。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	1. 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；
	2. 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 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	深证 300 指数上涨 5%	5,231,594.96	5,946,404.58
	深证 300 指数下跌 5%	-5,231,594.96	-5,946,404.58

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

截止资产负债表日，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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	104,827,596.91	99.26
	其中：股票	104,827,596.91	99.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	51,400.00	0.05
	其中：债券	51,400.00	0.05
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	728,492.74	0.69
8	其他资产	1,252.25	0.00
9	合计	105,608,741.90	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,644,325.80	3.46
B	采矿业	334,787.75	0.32
C	制造业	68,675,765.07	65.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	361,307.48	0.34
E	建筑业	231,286.77	0.22
F	批发和零售业	949,905.70	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	1,572,812.70	1.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,294,800.51	8.82
J	金融业	8,264,112.00	7.84
K	房地产业	4,764,641.38	4.52
L	租赁和商务服务业	1,662,988.44	1.58
M	科学研究和技术服务业	932,689.00	0.88
N	水利、环境和公共设施管理业	338,649.30	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	258,075.00	0.24
Q	卫生和社会工作	2,093,723.93	1.99

R	文化、体育和娱乐业	1,219,385.76	1.16
S	综合	228,340.32	0.22
	合计	104,827,596.91	99.45

7.2.2 报告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持有积极投资的股票组合。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	23,068	3,947,396.16	3.74
2	000333	美的集团	63,484	3,795,708.36	3.60
3	000651	格力电器	62,548	3,538,340.36	3.36
4	002475	立讯精密	54,888	2,818,498.80	2.67
5	000002	万科A	89,198	2,331,635.72	2.21
6	300750	宁德时代	10,700	1,865,652.00	1.77
7	002714	牧原股份	22,292	1,827,944.00	1.73
8	000725	京东方A	348,008	1,625,197.36	1.54
9	300760	迈瑞医疗	5,300	1,620,210.00	1.54
10	300059	东方财富	78,248	1,580,609.60	1.50
11	000661	长春高新	3,590	1,562,727.00	1.48
12	000001	平安银行	112,321	1,437,708.80	1.36

13	300498	温氏股份	63,197	1,377,694.60	1.31
14	002415	海康威视	45,311	1,375,188.85	1.30
15	000063	中兴通讯	32,683	1,311,568.79	1.24
16	002352	顺丰控股	18,900	1,033,830.00	0.98
17	300142	沃森生物	18,800	984,368.00	0.93
18	000100	TCL 科技	154,815	959,853.00	0.91
19	300015	爱尔眼科	22,041	957,681.45	0.91
20	002142	宁波银行	34,482	905,842.14	0.86
21	000568	泸州老窖	9,922	904,092.64	0.86
22	002410	广联达	11,853	826,154.10	0.78
23	002241	歌尔股份	27,390	804,170.40	0.76
24	000876	新 希 望	26,506	789,878.80	0.75
25	000338	潍柴动力	57,524	789,229.28	0.75
26	002027	分众传媒	140,888	784,746.16	0.74
27	002230	科大讯飞	20,485	766,753.55	0.73
28	002594	比亚迪	10,493	753,397.40	0.71
29	300014	亿纬锂能	15,618	747,321.30	0.71
30	002304	洋河股份	7,083	744,706.62	0.71
31	002555	三七互娱	15,000	702,000.00	0.67
32	300122	智飞生物	7,000	701,050.00	0.67
33	002007	华兰生物	13,477	675,332.47	0.64
34	300347	泰格医药	6,550	667,314.00	0.63
35	001979	招商蛇口	39,871	655,479.24	0.62
36	300601	康泰生物	3,800	616,208.00	0.58
37	000166	申万宏源	117,206	591,890.30	0.56
38	000538	云南白药	6,258	587,062.98	0.56
39	002271	东方雨虹	13,880	563,944.40	0.54
40	000895	双汇发展	12,118	558,518.62	0.53
41	300136	信维通信	10,400	551,408.00	0.52

42	300124	汇川技术	14,335	544,586.65	0.52
43	000938	紫光股份	12,384	532,264.32	0.50
44	000776	广发证券	37,692	532,211.04	0.50
45	300003	乐普医疗	14,406	526,107.12	0.50
46	002460	赣锋锂业	9,800	524,986.00	0.50
47	002129	中环股份	23,229	521,723.34	0.49
48	002624	完美世界	8,800	507,232.00	0.48
49	002050	三花智控	22,956	502,736.40	0.48
50	002371	北方华创	2,900	495,639.00	0.47
51	000977	浪潮信息	12,611	494,098.98	0.47
52	300253	卫宁健康	21,241	487,268.54	0.46
53	002127	南极电商	23,000	486,910.00	0.46
54	300413	芒果超媒	7,360	479,872.00	0.46
55	300454	深信服	2,300	473,708.00	0.45
56	002044	美年健康	32,528	468,728.48	0.44
57	002456	欧菲光	25,195	463,336.05	0.44
58	002311	海大集团	9,094	432,783.46	0.41
59	002001	新 和 成	14,814	431,087.40	0.41
60	002384	东山精密	14,350	429,782.50	0.41
61	300433	蓝思科技	14,919	418,328.76	0.40
62	002236	大华股份	21,645	415,800.45	0.39
63	002821	凯莱英	1,700	413,100.00	0.39
64	000157	中联重科	63,543	408,581.49	0.39
65	002602	世纪华通	26,180	400,815.80	0.38
66	002008	大族激光	11,040	396,888.00	0.38
67	002024	苏宁易购	44,825	393,115.25	0.37
68	300408	三环集团	13,800	382,260.00	0.36
69	002463	沪电股份	15,300	382,194.00	0.36
70	002185	华天科技	28,077	379,881.81	0.36

71	002841	视源股份	3,800	378,176.00	0.36
72	300558	贝达药业	2,700	377,946.00	0.36
73	300033	同花顺	2,832	376,882.56	0.36
74	002049	紫光国微	5,161	375,462.75	0.36
75	002439	启明星辰	8,920	375,264.40	0.36
76	300383	光环新网	14,200	370,194.00	0.35
77	300529	健帆生物	5,210	362,095.00	0.34
78	300676	华大基因	2,300	358,593.00	0.34
79	002405	四维图新	21,291	351,088.59	0.33
80	300661	圣邦股份	1,150	350,807.50	0.33
81	000860	顺鑫农业	6,150	350,427.00	0.33
82	300012	华测检测	17,600	347,776.00	0.33
83	000783	长江证券	50,899	343,059.26	0.33
84	002916	深南电路	2,040	341,740.80	0.32
85	000425	徐工机械	55,198	326,220.18	0.31
86	002202	金风科技	32,576	324,782.72	0.31
87	300450	先导智能	6,791	313,812.11	0.30
88	002385	大北农	34,387	313,265.57	0.30
89	002736	国信证券	27,675	312,727.50	0.30
90	300144	宋城演艺	18,076	312,714.80	0.30
91	002812	恩捷股份	4,730	311,234.00	0.30
92	000066	中国长城	23,536	310,675.20	0.29
93	002065	东华软件	24,760	309,995.20	0.29
94	000768	中航飞机	17,220	305,482.80	0.29
95	000069	华侨城 A	49,381	299,248.86	0.28
96	002157	正邦科技	17,100	298,908.00	0.28
97	002212	南洋股份	11,200	297,696.00	0.28
98	300088	长信科技	26,548	297,337.60	0.28
99	000625	长安汽车	26,581	292,391.00	0.28

100	002131	利欧股份	75,700	292,202.00	0.28
101	300782	卓胜微	720	292,154.40	0.28
102	002179	中航光电	7,080	290,350.80	0.28
103	300285	国瓷材料	8,500	284,835.00	0.27
104	002223	鱼跃医疗	7,626	277,586.40	0.26
105	002465	海格通信	21,430	277,304.20	0.26
106	002466	天齐锂业	11,915	273,449.25	0.26
107	300496	中科创达	3,500	271,950.00	0.26
108	002074	国轩高科	10,087	270,735.08	0.26
109	002600	领益智造	25,400	270,002.00	0.26
110	000656	金科股份	32,313	263,674.08	0.25
111	002493	荣盛石化	21,300	261,990.00	0.25
112	002120	韵达股份	10,666	260,783.70	0.25
113	002075	沙钢股份	20,800	260,000.00	0.25
114	002607	中公教育	9,300	258,075.00	0.24
115	000963	华东医药	10,173	257,376.90	0.24
116	000988	华工科技	10,446	255,195.78	0.24
117	002340	格林美	50,603	251,496.91	0.24
118	002422	科伦药业	11,916	250,236.00	0.24
119	300482	万孚生物	2,400	249,600.00	0.24
120	002601	龙蟠佰利	13,400	247,900.00	0.24
121	002373	千方科技	10,300	247,097.00	0.23
122	300271	华宇软件	8,700	245,427.00	0.23
123	000786	北新建材	11,444	244,100.52	0.23
124	002180	纳思达	7,400	243,534.00	0.23
125	000617	中油资本	23,300	242,087.00	0.23
126	000596	古井贡酒	1,600	240,384.00	0.23
127	300207	欣旺达	12,600	238,140.00	0.23
128	000513	丽珠集团	4,943	237,313.43	0.23

129	300595	欧普康视	3,400	235,756.00	0.22
130	000750	国海证券	54,249	235,440.66	0.22
131	300168	万达信息	10,488	231,470.16	0.22
132	002797	第一创业	33,020	228,498.40	0.22
133	000009	中国宝安	26,832	228,340.32	0.22
134	002507	涪陵榨菜	6,300	226,863.00	0.22
135	300759	康龙化成	2,300	226,320.00	0.21
136	300628	亿联网络	3,300	225,258.00	0.21
137	000703	恒逸石化	24,410	222,863.30	0.21
138	300058	蓝色光标	28,548	222,674.40	0.21
139	002252	上海莱士	26,213	221,761.98	0.21
140	300308	中际旭创	3,480	219,240.00	0.21
141	000021	深科技	10,000	218,300.00	0.21
142	000547	航天发展	15,833	216,437.11	0.21
143	002019	亿帆医药	9,400	215,918.00	0.20
144	000423	东阿阿胶	6,000	214,860.00	0.20
145	000728	国元证券	25,406	213,410.40	0.20
146	300699	光威复材	3,400	213,282.00	0.20
147	002138	顺络电子	8,500	212,075.00	0.20
148	000961	中南建设	23,740	211,286.00	0.20
149	002353	杰瑞股份	6,811	211,141.00	0.20
150	002414	高德红外	7,200	210,816.00	0.20
151	300024	机器人	15,384	210,299.28	0.20
152	300017	网宿科技	24,534	208,293.66	0.20
153	002156	通富微电	8,200	205,410.00	0.19
154	300009	安科生物	11,460	205,134.00	0.19
155	002299	圣农发展	6,999	202,971.00	0.19
156	300357	我武生物	3,200	199,200.00	0.19
157	002152	广电运通	15,360	198,758.40	0.19

158	300146	汤臣倍健	9,888	194,694.72	0.18
159	300316	晶盛机电	7,800	192,972.00	0.18
160	002511	中顺洁柔	8,600	191,780.00	0.18
161	002926	华西证券	18,000	191,340.00	0.18
162	002146	荣盛发展	23,505	190,390.50	0.18
163	002382	蓝帆医疗	6,300	189,693.00	0.18
164	002508	老板电器	6,090	189,459.90	0.18
165	000401	冀东水泥	11,700	187,668.00	0.18
166	002673	西部证券	22,902	186,880.32	0.18
167	000998	隆平高科	11,148	185,614.20	0.18
168	002938	鹏鼎控股	3,700	185,222.00	0.18
169	002739	万达电影	12,100	184,767.00	0.18
170	300773	拉卡拉	5,300	184,281.00	0.17
171	002396	星网锐捷	5,200	183,716.00	0.17
172	000623	吉林敖东	11,661	183,427.53	0.17
173	002500	山西证券	27,884	182,361.36	0.17
174	002572	索菲亚	7,500	181,275.00	0.17
175	002013	中航机电	22,908	180,973.20	0.17
176	000050	深天马 A	11,703	179,758.08	0.17
177	000630	铜陵有色	91,935	177,434.55	0.17
178	000975	银泰黄金	11,300	177,184.00	0.17
179	002195	二三四五	63,001	177,032.81	0.17
180	300274	阳光电源	12,200	175,558.00	0.17
181	002078	太阳纸业	18,200	173,264.00	0.16
182	002281	光迅科技	5,200	170,872.00	0.16
183	002773	康弘药业	3,430	170,128.00	0.16
184	300070	碧水源	20,621	167,442.52	0.16
185	000540	中天金融	51,464	165,714.08	0.16
186	300418	昆仑万维	6,600	164,736.00	0.16

187	002958	青农商行	37,100	164,353.00	0.16
188	001914	招商积余	5,300	162,869.00	0.15
189	002153	石基信息	4,138	161,506.14	0.15
190	002268	卫士通	7,420	158,342.80	0.15
191	002690	美亚光电	3,000	157,800.00	0.15
192	000997	新大陆	9,810	156,763.80	0.15
193	002032	苏泊尔	2,200	156,200.00	0.15
194	000686	东北证券	18,404	155,513.80	0.15
195	300001	特锐德	7,400	154,956.00	0.15
196	002939	长城证券	12,200	150,304.00	0.14
197	000413	东旭光电	55,365	147,824.55	0.14
198	000878	云南铜业	13,923	147,723.03	0.14
199	000581	威孚高科	7,077	146,352.36	0.14
200	300251	光线传媒	13,406	146,259.46	0.14
201	300113	顺网科技	5,700	144,780.00	0.14
202	002368	太极股份	3,300	144,177.00	0.14
203	000999	华润三九	4,912	143,381.28	0.14
204	002080	中材科技	9,200	142,600.00	0.14
205	002081	金螳螂	18,122	142,438.92	0.14
206	002294	信立泰	4,702	139,461.32	0.13
207	300296	利亚德	22,700	137,789.00	0.13
208	002217	合力泰	25,100	131,775.00	0.13
209	000671	阳光城	20,705	131,269.70	0.12
210	300166	东方国信	10,160	126,085.60	0.12
211	300747	锐科激光	1,150	125,154.50	0.12
212	000060	中金岭南	33,348	124,054.56	0.12
213	300618	寒锐钴业	2,000	124,040.00	0.12
214	002056	横店东磁	10,900	122,625.00	0.12
215	300766	每日互动	3,200	121,792.00	0.12

216	002151	北斗星通	3,700	118,511.00	0.11
217	000723	美锦能源	18,800	117,688.00	0.11
218	002558	巨人网络	6,700	116,580.00	0.11
219	002925	盈趣科技	2,000	115,880.00	0.11
220	002468	申通快递	6,900	113,229.00	0.11
221	300188	美亚柏科	5,700	113,031.00	0.11
222	000709	河钢股份	55,300	112,812.00	0.11
223	000778	新兴铸管	32,486	111,426.98	0.11
224	000627	天茂集团	20,816	108,451.36	0.10
225	000960	锡业股份	12,625	108,070.00	0.10
226	000729	燕京啤酒	15,776	108,065.60	0.10
227	000402	金融街	15,980	106,107.20	0.10
228	002595	豪迈科技	5,400	105,084.00	0.10
229	000738	航发控制	7,648	104,395.20	0.10
230	002242	九阳股份	2,800	104,356.00	0.10
231	002831	裕同科技	3,760	103,437.60	0.10
232	002038	双鹭药业	8,042	103,018.02	0.10
233	003816	中国广核	34,700	102,712.00	0.10
234	000967	盈峰环境	12,200	100,650.00	0.10
235	002110	三钢闽光	15,050	100,233.00	0.10
236	000830	鲁西化工	13,400	99,964.00	0.09
237	000629	攀钢钒钛	48,900	98,289.00	0.09
238	002191	劲嘉股份	10,900	97,119.00	0.09
239	000983	西山煤电	25,701	96,378.75	0.09
240	002506	协鑫集成	36,900	96,309.00	0.09
241	002085	万丰奥威	14,840	96,163.20	0.09
242	300133	华策影视	13,210	95,772.50	0.09
243	000825	太钢不锈	28,665	95,167.80	0.09
244	002399	海普瑞	3,800	95,152.00	0.09

245	000564	供销大集	20,900	93,841.00	0.09
246	000089	深圳机场	12,200	93,452.00	0.09
247	300180	华峰超纤	10,800	92,448.00	0.09
248	000039	中集集团	12,727	92,016.21	0.09
249	000598	兴蓉环境	19,793	91,047.80	0.09
250	000807	云铝股份	20,600	89,816.00	0.09
251	002092	中泰化学	19,733	89,390.49	0.08
252	002310	东方园林	18,395	88,847.85	0.08
253	000563	陕国投 A	23,900	88,669.00	0.08
254	002010	传化智联	16,100	87,584.00	0.08
255	000883	湖北能源	24,843	87,447.36	0.08
256	000932	华菱钢铁	22,580	85,126.60	0.08
257	000028	国药一致	1,855	83,493.55	0.08
258	002583	海能达	11,000	83,490.00	0.08
259	002670	国盛金控	9,000	82,350.00	0.08
260	000839	中信国安	34,410	81,895.80	0.08
261	002745	木林森	5,300	81,673.00	0.08
262	000415	渤海租赁	27,206	81,073.88	0.08
263	000027	深圳能源	17,263	80,100.32	0.08
264	000559	万向钱潮	16,468	79,705.12	0.08
265	002936	郑州银行	22,880	78,707.20	0.07
266	000046	泛海控股	20,618	77,729.86	0.07
267	000930	中粮科技	11,100	75,813.00	0.07
268	000708	中信特钢	4,400	75,196.00	0.07
269	002372	伟星新材	6,400	74,432.00	0.07
270	002244	滨江集团	17,100	73,017.00	0.07
271	000987	越秀金控	6,200	72,292.00	0.07
272	000898	鞍钢股份	29,440	72,128.00	0.07
273	002901	大博医疗	600	71,574.00	0.07

274	000826	启迪环境	9,509	70,556.78	0.07
275	002625	光启技术	9,700	70,325.00	0.07
276	300748	金力永磁	2,100	70,098.00	0.07
277	002064	华峰氨纶	13,600	68,952.00	0.07
278	000301	东方盛虹	12,300	68,388.00	0.06
279	000031	大悦城	13,200	67,188.00	0.06
280	300072	三聚环保	15,426	66,023.28	0.06
281	002302	西部建设	6,800	65,280.00	0.06
282	000732	泰禾集团	12,800	65,152.00	0.06
283	000990	诚志股份	5,100	64,719.00	0.06
284	002563	森马服饰	8,900	62,745.00	0.06
285	300741	华宝股份	1,700	62,696.00	0.06
286	002128	露天煤业	7,900	61,225.00	0.06
287	002867	周大生	2,700	59,859.00	0.06
288	002653	海思科	2,200	58,542.00	0.06
289	300616	尚品宅配	900	54,072.00	0.05
290	001965	招商公路	7,600	51,148.00	0.05
291	300761	立华股份	1,300	50,102.00	0.05
292	300783	三只松鼠	600	45,588.00	0.04
293	000553	安道麦 A	4,800	43,296.00	0.04
294	002948	青岛银行	8,300	42,247.00	0.04
295	000959	首钢股份	9,700	41,710.00	0.04
296	000537	广宇发展	5,700	41,610.00	0.04
297	002966	苏州银行	4,600	38,548.00	0.04
298	002423	中粮资本	2,400	20,880.00	0.02
299	001872	招商港口	1,400	20,370.00	0.02
300	000785	居然之家	2,100	16,632.00	0.02

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持有积极投资的股票。

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	002714	牧原股份	371,608.00	0.31
2	002352	顺丰控股	369,148.00	0.31
3	002131	利欧股份	328,335.00	0.27
4	300661	圣邦股份	275,036.50	0.23
5	000002	万科A	271,005.00	0.22
6	002841	视源股份	265,058.00	0.22
7	000895	双汇发展	261,169.00	0.22
8	300782	卓胜微	244,007.00	0.20
9	000021	深科技	239,619.00	0.20
10	000617	中油资本	225,668.48	0.19
11	300482	万孚生物	217,872.00	0.18
12	002156	通富微电	206,830.00	0.17
13	002396	星网锐捷	183,670.00	0.15
14	001914	招商积余	176,000.00	0.15
15	300433	蓝思科技	149,288.00	0.12
16	002958	青农商行	138,460.00	0.11
17	300773	拉卡拉	136,530.00	0.11
18	000938	紫光股份	132,226.00	0.11
19	002602	世纪华通	127,142.00	0.11
20	003816	中国广核	120,588.00	0.10

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	501,430.46	0.42
2	000661	长春高新	446,816.00	0.37

3	000333	美的集团	271,731.00	0.23
4	000001	平安银行	216,353.00	0.18
5	300760	迈瑞医疗	175,359.00	0.15
6	002821	凯莱英	174,300.00	0.14
7	000651	格力电器	165,907.00	0.14
8	002262	恩华药业	124,865.37	0.10
9	300454	深信服	120,982.00	0.10
10	000681	视觉中国	120,574.00	0.10
11	003816	中国广核	115,510.00	0.10
12	002916	深南电路	114,893.00	0.10
13	000690	宝新能源	114,533.64	0.10
14	300750	宁德时代	111,993.00	0.09
15	300498	温氏股份	107,737.00	0.09
16	300059	东方财富	100,121.00	0.08
17	300170	汉得信息	97,846.00	0.08
18	300676	华大基因	96,480.00	0.08
19	000596	古井贡酒	94,875.00	0.08
20	002415	海康威视	94,464.00	0.08

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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	7,677,336.37
卖出股票收入（成交）总额	8,529,842.39

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）	51,400.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	51,400.00	0.05

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	128112	歌尔转 2	400	40,000.00	0.04
2	128114	正邦转债	114	11,400.00	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,182.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	69.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,252.25

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 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

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		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	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,207	29,700.49	48,000,433.00	73.23	17,548,558.00	26.77	47,014,142.00	71.72

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”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	钱中明	1,163,201.00	1.77
2	谢少云	746,200.00	1.14
3	北京无限立通通讯技术有限责任公司	708,499.00	1.08
4	付秀建	386,600.00	0.59
5	吴淳欣	384,800.00	0.59
6	侯小蔓	363,900.00	0.56
7	刘巍	298,400.00	0.46
8	苏州市城市建设	244,792.00	0.37

	开发有限公司		
9	伞国颖	234,000.00	0.36
10	吴宗豪	230,000.00	0.35
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	47,014,142.00	71.72

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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09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	86,348,991.00
本报告期基金总申购份额	14,400,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	35,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	65,548,991.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例 (%)		比例 (%)	
东方 证券	4	16,095,842.15	100.00	14,668.21	100.00	
长城 证券	2	-	-	-	-	
长江 证券	1	-	-	-	-	
东北 证券	2	-	-	-	-	
东吴 证券	1	-	-	-	-	
东兴 证券	1	-	-	-	-	
广发 证券	1	-	-	-	-	
国海 证券	2	-	-	-	-	
国泰 君安	1	-	-	-	-	
国信 证券	2	-	-	-	-	
海通 证券	1	-	-	-	-	
恒泰 证券	2	-	-	-	-	
华泰 证券	2	-	-	-	-	
华西	1	-	-	-	-	

证券						
平安 证券	1	-	-	-	-	
瑞银 证券	2	-	-	-	-	
申万 宏源 证券	1	-	-	-	-	
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	
信达 证券	1	-	-	-	-	
兴业 证券	1	-	-	-	-	
银河 证券	1	-	-	-	-	
中金 公司	2	-	-	-	-	
中泰 证券	1	-	-	-	-	
中信 建投 证券	1	-	-	-	-	
中信 证券	2	-	-	-	-	
中银 国际	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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	334,210.85	100.00	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-

国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

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部分基金参加交通银行开展的费率优惠活动的公告	上证报, 公司网站	2020 年 01 月 02 日
2	汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年第 4 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 01 月 21 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金暂停申购、赎回 等业务的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 01 月 31 日
4	汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年年度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 03 月 30 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所	2020 年 04 月 01 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 (2020 年 4 月 15 日更新)	证券时报, 公司网站, 深交所	2020 年 04 月 15 日
7	汇添富基金旗下 145 只基金 2020 年 1 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 04 月 21 日

8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分 ETF 修改标的指数使用许可费并修改基金合同、托管协议、招募说明书的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所	2020 年 04 月 29 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金中基金 (FOF) 资产管理计划通过直销渠道申赎本公司旗下公募基金免除相关费用的公告	中证报, 公司网站	2020 年 04 月 29 日
10	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2020 年 5 月 7 日更新)	证券时报, 公司网站, 深交所	2020 年 05 月 07 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者超过 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		比 例 达 到 或 者 超 过 20% 的 时 间 区 间					
中 国 工 商 银 行 股 份 有 限 公 司 — 汇 添	1	202 0年 1月 1日 至 202 0年 6月 30 日	59,814,142.0 0	4,800,000.0 0	17,600,000.0 0	47,014,142.0 0	71.7 2

富 深 证 30 0 交 易 型 开 放 式 指 数 证 券 投 资 基 金 联 接 基 金							
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险</p> <p>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</p> <p>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</p>							

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。

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。

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 20 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

2020 年 08 月 28 日