

深证 300 价值交易型开放式指数证券投资  
基金  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40

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	40
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	40
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	41
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	41
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12	投资组合报告附注	41
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>42</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2	期末上市基金前十名持有人	43
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>43</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>44</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4	基金投资策略的改变	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8	其他重大事件	45
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>45</b>
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	45
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	46
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>46</b>
12.1	备查文件目录	46
12.2	存放地点	46
12.3	查阅方式	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	交银深证 300 价值 ETF
场内简称	深价值 ETF
基金主代码	159913
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 22 日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	28,329,693.00 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 年 10 月 25 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	本基金绝大部分资产采用完全复制法，跟踪深证 300 价值价格指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	深证 300 价值价格指数
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，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		交银施罗德基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王晚婷	任航
	联系电话	(021) 61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95599
传真		(021) 61055054	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号交通银行大楼二层（裙）	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心	北京市西城区复兴门内大街

	二期 21-22 楼	28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	谢卫（代任）	谷澍

## 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.fund001.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

## 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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-919,044.93
本期利润	2,961,022.17
加权平均基金份额本期利润	0.1072
本期加权平均净值利润率	5.52%
本期基金份额净值增长率	5.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	27,039,731.62
期末可供分配基金份额利润	0.9545
期末基金资产净值	55,369,424.62
期末基金份额净值	1.954
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	95.40%

注：1、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，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

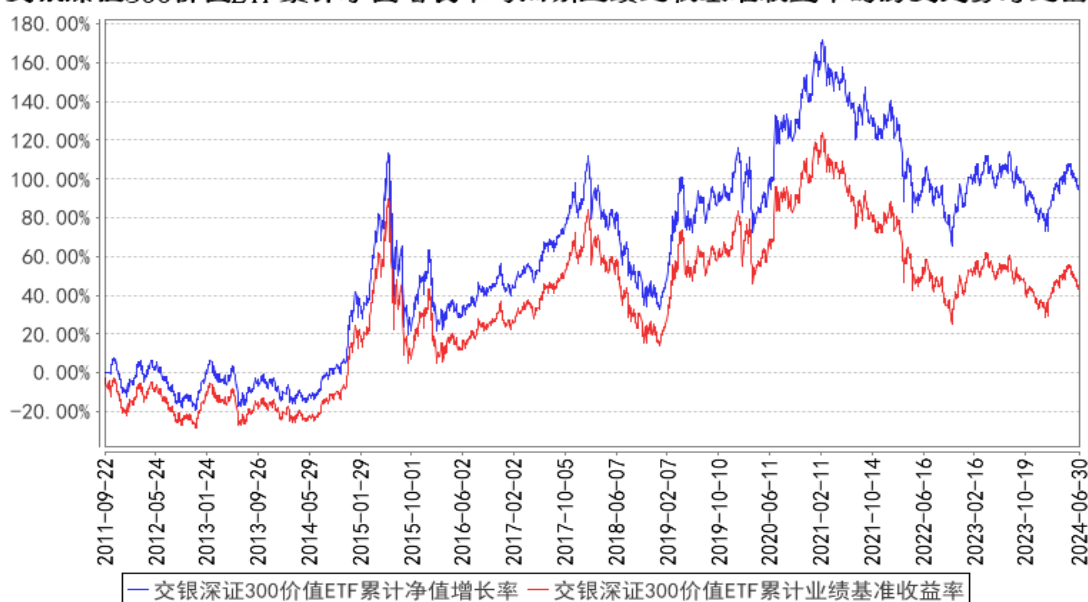
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.79%	0.70%	-3.56%	0.70%	0.77%	0.00%

过去三个月	0.31%	0.92%	-1.31%	0.94%	1.62%	-0.02%
过去六个月	5.85%	1.03%	4.56%	1.05%	1.29%	-0.02%
过去一年	-4.91%	0.94%	-6.74%	0.96%	1.83%	-0.02%
过去三年	-19.02%	1.10%	-25.69%	1.13%	6.67%	-0.03%
自基金合同生效起至今	95.40%	1.44%	44.01%	1.48%	51.39%	-0.04%

注：本基金的业绩比较基准为深证 300 价值价格指数。

### 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

交银深证300价值ETF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：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 3 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

## § 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

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65% 的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30% 的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5% 的股份。公司并下设交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、混合型和股票型在内的 130 只基金，其中股票

型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII 等不同类型基金。

#### 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		
邵文婷	交银上证 180 公司治理 ETF 及其联接、交银深证 300 价值 ETF 及其联接、交银中证海外中国互联网指数（QDII-LOF）、交银中证环境治理指数（LOF）、交银创业板 50 指数、交银国证新能源指数（LOF）、交银定期支付月月丰债券、交银中证红利低波动 100 指数的基金经理	2021 年 4 月 30 日	-	8 年	邵文婷女士，中国国籍，英国诺丁汉大学金融与投资硕士、西南财经大学数学与经济学双学士。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、投资经理。

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告（如适用）之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。



## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金整体运作符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

## 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

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循公平交易分配原则对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司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没有超过该证券当日总成交量 5% 的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差未出现异常。

## 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

2024 年上半年，国内稳增长稳信心政策持续加码，宏观经济运行总体呈现先回升、后趋缓态势，经济回升基础仍需巩固。上半年，制造业、非制造业景气度均先升后降。制造业方面，三月制造业 PMI 大幅回升 1.7 个百分点至 50.8%，创十二个月新高，主因春节后企业复工复产加快，带动供给需求抬升。企业生产端来看，生产指数于三月生产旺季回升至扩张区间。需求端亦呈修

复态势，内外部需求走强支撑一季度经济景气保持扩张。而五月以来，制造业景气度呈现回落态势。制造业 PMI 连续两月降至荣枯线以下，新订单、新出口订单指数亦回落至收缩区间，指向内外部需求均有压力，企业生产亦有所放缓。非制造业方面，一季度非制造业景气度持续回升。气候转暖和节后集中开工，各地建筑工程施工进度加快，带动建筑业 PMI 回暖。服务业方面，受春节假期等因素带动，一季度服务业商务活动指数连续回升。而二季度以来，受到多地持续强降雨、建筑业新项目不足等影响，非制造业景气度持续回落，建筑业、服务业景气同步转弱。流动性方面，二月央行分别降准 50BP、下调五年期 LPR25BP。上半年，国债利率持续下行，市场流动性较为宽裕。政策方面，超长期特别国债、大规模设备更新、消费品以旧换新等政策加速落地。地产政策亦持续优化，陆续出台放松限购、降低首付比例、下调房贷利率等政策，全国稳楼市政策预期进一步明确。回顾上半年，A 股市场整体呈现先震荡上行、后下行走势。年初，国内经济复苏偏弱，美联储降息预期回落，压制风险资产表现，A 股市场表现疲软，期间以银行、煤炭为代表的高股息板块较为抗跌。春节前后，央行降准降息相继落地，北向资金持续流入，多方面因素驱动 A 股市场迎来超跌反弹，期间有色、通信、计算机等成长板块反弹较多，AI、低空经济等热点主题亦有所表现。随后，四月至五月中旬，新国九条、地产等政策相继发力，同时海外不确定性提升，人民币资产获得资金青睐，期间地产链领涨。五月下旬以来，社融、新增人民币贷款等金融数据偏弱，加剧市场对经济复苏力度的担忧，期间 A 股市场呈现普跌状态。作为跟踪基准指数的指数基金，本基金在上半年总体呈现震荡上行态势。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，中国经济处于高质量发展转型期，政策将继续聚焦稳增长、稳信心、防风险，保障房建设和收储、地产“以旧换新”、新质生产力等相关政策有望得到进一步细化落地。2024 年政府工作报告指出“大力推进现代化产业体系建设，加快发展新质生产力”，“积极培育新兴产业和未来产业”，“巩固扩大智能网联新能源汽车等产业领先优势，加快前沿新兴氢能、新材料、创新药等产业发展，积极打造生物制造、商业航天、低空经济等新增长引擎”。此外，当前资本市场政策红利下制度不断完善，新国九条突出强本强基、严监严管，预计未来将有更多举措推动资本市场高质量发展。六月，证监会发布科创板八条措施，旨在深化科创板改革，优化科技企业融资环境，促进科技创新和新质生产力发展。预计后续产业政策落地将对 A 股市场形成一定支撑，未来符合产业趋势、估值合理、基本面较为确定的优质标的值得关注。总体而言，从中长期

来看，我们对 A 股市场维持谨慎乐观的看法。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金本报告期内无需预警说明。

## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人

利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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 价值交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,752,507.12	1,138,550.17
结算备付金		2,109.10	-
存出保证金		2,645.83	5,845.28
交易性金融资产	6.4.7.2	53,796,138.42	48,591,601.66
其中：股票投资		53,796,138.42	48,591,601.66
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		55,553,400.47	49,735,997.11
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2024年6月30日</b>	<b>2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		22,919.93	20,669.23
应付托管费		4,584.00	4,133.84
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	156,471.92	194,148.45
负债合计		183,975.85	218,951.52
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	28,329,693.00	26,829,693.00
未分配利润	6.4.7.12	27,039,731.62	22,687,352.59
净资产合计		55,369,424.62	49,517,045.59
负债和净资产总计		55,553,400.47	49,735,997.11

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.954 元，基金份额总额 28,329,693.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		3,239,818.23	4,472,462.77
1. 利息收入		4,856.79	5,487.31
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,856.79	5,487.31
债券利息收入		-	-
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）		-646,920.66	591,350.06
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,661,484.45	-354,241.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,014,563.79	945,591.38
以摊余成本计量的		-	-
金融资产终止确认产生的		-	-
收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	3,880,067.10	3,878,648.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,815.00	-3,022.71
<b>减：二、营业总支出</b>		278,796.06	273,458.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	133,245.39	116,475.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	26,649.11	23,295.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产		-	-
支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	118,901.56	133,687.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,961,022.17	4,199,004.72
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,961,022.17	4,199,004.72
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		2,961,022.17	4,199,004.72

### 6.3 净资产变动表

会计主体：深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	26,829,693.00	-	22,687,352.59	49,517,045.59
二、本期期初净资产	26,829,693.00	-	22,687,352.59	49,517,045.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,500,000.00	-	4,352,379.03	5,852,379.03
(一)、综合收益总额	-	-	2,961,022.17	2,961,022.17
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,500,000.00	-	1,391,356.86	2,891,356.86
其中：1. 基金申购款	8,700,000.00	-	7,278,530.77	15,978,530.77
2. 基金赎回款	-7,200,000.00	-	-5,887,173.91	-13,087,173.91
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	28,329,693.00	-	27,039,731.62	55,369,424.62
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	22,629,693.00	-	19,555,771.16	42,185,464.16
二、本期期初净资产	22,629,693.00	-	19,555,771.16	42,185,464.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,200,000.00	-	5,579,073.44	6,779,073.44
(一)、综合收益总额	-	-	4,199,004.72	4,199,004.72
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数	1,200,000.00	-	1,380,068.72	2,580,068.72

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	216,300,000.00	-	218,058,810.36	434,358,810.36
2. 基金赎回款	-215,100,000.00	-	-216,678,741.64	-431,778,741.64
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	23,829,693.00	-	25,134,844.60	48,964,537.60

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：

谢卫

印皓

单江

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 价值交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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]第 967 号《关于核准深证 300 价值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》核准,由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 332,308,859.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 374 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 332,329,693.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 20,834.00 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2011]第 318 号文审核同意,本基金于 2011 年 10 月 25 日在深交所挂牌交易。



根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数深证 300 价值价格指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数的成份股（含存托凭证）和备选成份股（含存托凭证），该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；本基金也可少量投资于新股（含存托凭证）、债券、回购、权证及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）。在正常市场情况下，力争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%。本基金的业绩比较基准为深证 300 价值价格指数。

交银施罗德基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2011 年 9 月 28 日募集成立了交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“深证 300 价值 ETF 联接基金”）。深证 300 价值 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2024 年 8 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年上半年度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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,752,507.12
等于：本金	1,752,163.76
加：应计利息	343.36
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,752,507.12

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	54,553,090.16	-	53,796,138.42	-756,951.74
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	54,553,090.16	-	53,796,138.42	-756,951.74
----	---------------	---	---------------	-------------

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 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

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.7.8 其他资产

无。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 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	-
应付交易费用	7,190.36
其中：交易所市场	7,190.36
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	14,918.54
预提信息披露费	24,863.02
应付指数使用费	105,000.00
预提账户维护费	4,500.00
合计	156,471.92

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,829,693.00	26,829,693.00
本期申购	8,700,000.00	8,700,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-7,200,000.00	-7,200,000.00
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	28,329,693.00	28,329,693.00

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 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	37,979,087.41	-15,291,734.82	22,687,352.59
本期期初	37,979,087.41	-15,291,734.82	22,687,352.59
本期利润	-919,044.93	3,880,067.10	2,961,022.17

本期基金份额交易产生的变动数	2,106,397.41	-715,040.55	1,391,356.86
其中：基金申购款	12,124,176.92	-4,845,646.15	7,278,530.77
基金赎回款	-10,017,779.51	4,130,605.60	-5,887,173.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,166,439.89	-12,126,708.27	27,039,731.62

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		4,697.39
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		135.30
其他		24.10
合计		4,856.79

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-434,285.97
股票投资收益——赎回差价收入		-1,227,198.48
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		-1,661,484.45

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		4,955,921.70
减：卖出股票成本总额		5,379,761.46
减：交易费用		10,446.21
买卖股票差价收入		-434,285.97

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
赎回基金份额对价总额		13,087,173.91
减：现金支付赎回款总额		-264,414.09

减：赎回股票成本总额	14,578,786.48
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,227,198.48

#### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,014,563.79
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	1,014,563.79

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,880,067.10
股票投资	3,880,067.10
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	-
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	3,880,067.10

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日



基金赎回费收入	-
替代损益	1,815.00
合计	1,815.00

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行费用	120.00
指数使用费	70,000.00
债券账户费用	9,000.00
合计	118,901.56

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起至 2020 年 3 月 31 日，标的指数许可使用费的收取下限为每季(自然季度)人民币 50,000 元；根据 2020 年 5 月 25 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于调整深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金标的指数许可使用费并修改法律文件的公告》，自 2020 年 4 月 1 日起，如当季度基金日均资产净值大于人民币 5,000 万元，支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限调整为每季(自然季度)人民币 35,000 元；如当季度基金日均资产净值小于或等于人民币 5,000 万元，支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 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
交银施罗德基金管理有限公司（“交银施罗德基金公司”）	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司
交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“交银深证 300 价值 ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
上海直源投资管理有限公司	受基金管理人控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

本报告期实际与基金发生关联交易的关联方及关联交易具体情况请见下述内容。

## 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

无。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	133,245.39	116,475.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	133,245.39	116,475.06

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% ÷ 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	26,649.11	23,295.02

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% ÷ 当年天数。

#### 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

无。

#### 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

无。

##### 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

无。

#### 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

无。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
-------	------------------------	--------------------------

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
交银深证300 价值ETF联接 基金	26,402,500.00	93.20	25,202,500.00	93.94

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中国农业银行_活期存款	1,752,507.12	4,697.39	1,365,596.73	4,537.67

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，存款利率参考银行同业利率及银行存款利率确定。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2024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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 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

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 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

本基金是指数型基金，紧密跟踪深证 300 价值价格指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象（含中小板股票和创业板股票及其他经中国证监会核准的上市股票、存托凭证）。此外，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（含存托凭证）、债券、回购、权证及中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金绝大部分资产采用完全复制法，跟踪深证 300 价值价格指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部风险控制执行情况。本基金的基金管理人建立了以合规审核及风险管理委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2023 年 12 月 31 日：无）。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不付息，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### **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在基金运作过程中严格按照《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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要

求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持证券在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,752,507.12	-	-	-	1,752,507.12
结算备付金	2,109.10	-	-	-	2,109.10
存出保证金	2,645.83	-	-	-	2,645.83
交易性金融资产	-	-	-	53,796,138.42	53,796,138.42
资产总计	1,757,262.05	-	-	53,796,138.42	55,553,400.47
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	22,919.93	22,919.93
应付托管费	-	-	-	4,584.00	4,584.00
其他负债	-	-	-	156,471.92	156,471.92
负债总计	-	-	-	183,975.85	183,975.85
利率敏感度缺口	1,757,262.05	-	-	53,612,162.57	55,369,424.62
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	1,138,550.17	-	-	-	1,138,550.17
存出保证金	5,845.28	-	-	-	5,845.28
交易性金融资产	-	-	-	48,591,601.66	48,591,601.66
资产总计	1,144,395.45	-	-	48,591,601.66	49,735,997.11
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	20,669.23	20,669.23
应付托管费	-	-	-	4,133.84	4,133.84
其他负债	-	-	-	194,148.45	194,148.45
负债总计	-	-	-	218,951.52	218,951.52
利率敏感度缺口	1,144,395.45	-	-	48,372,650.14	49,517,045.59

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金绝大部分资产采用完全复制法，跟踪深证 300 价值价格指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，深证 300 价值价格指数成份股(含存托凭证)和备选成份股(含存托凭证)的资产比例不低于基金资产净值的 95%，新股(含存托凭证)、债券、回购、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具投资比例不高于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风



险进行跟踪和控制。

#### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	53,796,138.42	97.16	48,591,601.66	98.13
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	53,796,138.42	97.16	48,591,601.66	98.13

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
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(2024年6月30日)	上年度末(2023年12月31日)
	1. 业绩比较基准上涨 5%	2,704,688.19	2,407,078.34
2. 业绩比较基准下降 5%	-2,704,688.19	-2,407,078.34	

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	53,796,138.42	48,591,601.66
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	53,796,138.42	48,591,601.66

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

## 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

## 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	53,796,138.42	96.84
	其中：股票	53,796,138.42	96.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	1,754,616.22	3.16
8	其他各项资产	2,645.83	0.00
9	合计	55,553,400.47	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

## 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	-	-
B	采矿业	847,063.06	1.53
C	制造业	41,152,414.31	74.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,701,836.59	3.07
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	592,363.00	1.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	522,475.00	0.94
J	金融业	6,039,309.34	10.91
K	房地产业	1,459,274.94	2.64
L	租赁和商务服务业	1,204,350.00	2.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	271,372.00	0.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	53,790,458.24	97.15

### 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

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	-	-
B	采矿业	1,629.00	0.00
C	制造业	2,688.22	0.00
D	电力、热力、燃气	-	-

	及水生产和供应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	343.00	0.00
J	金融业	869.00	0.00
K	房地产业	150.96	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,680.18	0.01

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	88,113	5,683,288.50	10.26
2	002594	比亚迪	15,500	3,878,875.00	7.01
3	000651	格力电器	80,774	3,167,956.28	5.72
4	000725	京东方 A	576,385	2,357,414.65	4.26
5	000063	中兴通讯	57,900	1,619,463.00	2.92
6	000001	平安银行	153,800	1,561,070.00	2.82
7	000338	潍柴动力	92,256	1,498,237.44	2.71
8	000100	TCL 科技	329,960	1,425,427.20	2.57
9	002142	宁波银行	62,124	1,370,455.44	2.48
10	000792	盐湖股份	70,400	1,228,480.00	2.22
11	002027	分众传媒	183,500	1,112,010.00	2.01
12	000625	长安汽车	78,032	1,047,969.76	1.89

13	000425	徐工机械	138,649	991,340.35	1.79
14	000002	万科 A	111,500	772,695.00	1.40
15	000538	云南白药	14,000	716,100.00	1.29
16	000166	申万宏源	160,400	691,324.00	1.25
17	300433	蓝思科技	35,300	644,225.00	1.16
18	002422	科伦药业	21,200	642,996.00	1.16
19	000776	广发证券	51,500	626,755.00	1.13
20	000157	中联重科	81,447	625,512.96	1.13
21	003816	中国广核	126,900	587,547.00	1.06
22	000933	神火股份	28,000	566,440.00	1.02
23	002648	卫星化学	31,300	562,774.00	1.02
24	002466	天齐锂业	18,700	559,317.00	1.01
25	001979	招商蛇口	62,086	545,735.94	0.99
26	002001	新和成	28,082	539,174.40	0.97
27	002236	大华股份	34,000	525,640.00	0.95
28	002601	龙佰集团	28,200	523,674.00	0.95
29	000423	东阿阿胶	8,200	513,320.00	0.93
30	000807	云铝股份	37,900	512,029.00	0.92
31	000661	长春高新	5,500	504,735.00	0.91
32	000786	北新建材	16,600	492,356.00	0.89
33	000983	山西焦煤	45,526	469,373.06	0.85
34	000895	双汇发展	19,438	462,041.26	0.83
35	002938	鹏鼎控股	11,500	457,240.00	0.83
36	000630	铜陵有色	125,915	454,553.15	0.82
37	002966	苏州银行	55,330	414,975.00	0.75
38	002078	太阳纸业	28,600	398,970.00	0.72
39	002353	杰瑞股份	10,900	382,372.00	0.69
40	002128	电投能源	17,900	377,690.00	0.68
41	002532	天山铝业	46,300	375,493.00	0.68
42	002600	领益智造	51,300	365,256.00	0.66
43	002459	晶澳科技	32,600	365,120.00	0.66
44	002555	三七互娱	26,700	348,435.00	0.63
45	001965	招商公路	27,500	326,150.00	0.59
46	000932	华菱钢铁	73,300	324,719.00	0.59
47	000408	藏格矿业	13,400	322,538.00	0.58
48	000683	远兴能源	46,400	320,624.00	0.58
49	002202	金风科技	47,475	319,032.00	0.58
50	000878	云南铜业	25,600	318,976.00	0.58
51	002738	中矿资源	11,500	308,200.00	0.56
52	000999	华润三九	6,901	293,844.58	0.53
53	000728	国元证券	48,325	292,849.50	0.53
54	000960	锡业股份	17,500	271,075.00	0.49
55	000783	长江证券	55,400	267,582.00	0.48

56	000513	丽珠集团	6,840	254,516.40	0.46
57	000703	恒逸石化	35,690	253,042.10	0.46
58	000617	中油资本	45,460	250,939.20	0.45
59	300073	当升科技	7,300	250,463.00	0.45
60	300146	汤臣倍健	17,900	242,545.00	0.44
61	300919	中伟股份	7,500	232,425.00	0.42
62	000921	海信家电	7,200	232,128.00	0.42
63	000591	太阳能	48,100	226,551.00	0.41
64	002064	华峰化学	31,100	222,987.00	0.40
65	000623	吉林敖东	16,339	218,942.60	0.40
66	000830	鲁西化工	18,400	213,256.00	0.39
67	000708	中信特钢	15,400	208,978.00	0.38
68	002756	永兴材料	5,700	203,946.00	0.37
69	000883	湖北能源	32,059	192,674.59	0.35
70	002429	兆驰股份	39,100	188,071.00	0.34
71	002508	老板电器	8,400	185,640.00	0.34
72	300390	天华新能	10,680	183,482.40	0.33
73	002120	韵达股份	23,700	183,438.00	0.33
74	000887	中鼎股份	14,800	181,152.00	0.33
75	002056	横店东磁	14,500	180,815.00	0.33
76	002831	裕同科技	7,000	179,130.00	0.32
77	002372	伟星新材	11,400	175,788.00	0.32
78	002624	完美世界	22,900	174,040.00	0.31
79	002926	华西证券	26,400	173,976.00	0.31
80	002500	山西证券	35,100	164,970.00	0.30
81	000027	深圳能源	22,420	163,666.00	0.30
82	002080	中材科技	12,600	162,540.00	0.29
83	001286	陕西能源	14,000	161,420.00	0.29
84	002572	索菲亚	10,100	154,833.00	0.28
85	300070	碧水源	36,800	154,192.00	0.28
86	002244	滨江集团	19,400	140,844.00	0.25
87	000709	河钢股份	70,562	136,890.28	0.25
88	000877	天山股份	25,300	136,620.00	0.25
89	001227	兰州银行	52,100	123,998.00	0.22
90	002032	苏泊尔	2,400	120,240.00	0.22
91	002266	浙富控股	42,000	117,180.00	0.21
92	000987	越秀资本	20,245	100,415.20	0.18
93	000785	居然之家	38,000	92,340.00	0.17
94	002608	江苏国信	11,300	87,575.00	0.16
95	000958	电投产融	23,000	84,180.00	0.15
96	001872	招商港口	4,300	82,775.00	0.15
97	000537	中绿电	8,300	79,099.00	0.14
98	000539	粤电力 A	15,300	77,724.00	0.14

99	000959	首钢股份	24,700	67,184.00	0.12
100	001289	龙源电力	2,400	41,400.00	0.07

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000975	银泰黄金	100	1,629.00	0.00
2	002407	多氟多	100	1,223.00	0.00
3	002152	广电运通	99	1,035.54	0.00
4	002736	国信证券	100	869.00	0.00
5	002030	达安基因	80	400.00	0.00
6	002602	世纪华通	100	343.00	0.00
7	000069	华侨城 A	74	150.96	0.00
8	000898	鞍钢股份	14	29.68	0.00

### 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	002648	卫星化学	556,385.16	1.12
2	000661	长春高新	551,746.00	1.11
3	002236	大华股份	550,115.00	1.11
4	002459	晶澳科技	457,748.00	0.92
5	002738	中矿资源	331,177.00	0.67
6	000921	海信家电	275,957.00	0.56
7	300073	当升科技	260,864.00	0.53
8	300919	中伟股份	259,839.00	0.52
9	300146	汤臣倍健	253,608.00	0.51
10	000703	恒逸石化	241,588.00	0.49
11	002056	横店东磁	193,570.00	0.39
12	002429	兆驰股份	189,172.00	0.38
13	002120	韵达股份	181,154.00	0.37
14	001965	招商公路	131,699.00	0.27
15	001979	招商蛇口	96,867.00	0.20
16	000537	中绿电	92,428.00	0.19
17	000539	粤电力 A	84,722.00	0.17
18	000425	徐工机械	78,712.00	0.16
19	002422	科伦药业	71,507.00	0.14
20	002532	天山铝业	37,191.00	0.08

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）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	000768	中航西飞	579,909.00	1.17
2	000975	银泰黄金	553,948.00	1.12
3	002493	荣盛石化	532,710.00	1.08
4	002736	国信证券	486,314.00	0.98
5	002152	广电运通	248,691.00	0.50
6	002558	巨人网络	237,257.00	0.48
7	002407	多氟多	223,073.00	0.45
8	000333	美的集团	185,700.00	0.38
9	002497	雅化集团	177,564.00	0.36
10	000050	深天马 A	160,695.00	0.32
11	000825	太钢不锈	137,720.00	0.28
12	002594	比亚迪	111,562.00	0.23
13	000999	华润三九	103,304.70	0.21
14	300888	稳健医疗	89,877.00	0.18
15	000898	鞍钢股份	87,311.00	0.18
16	000401	冀东水泥	78,982.00	0.16
17	301035	润丰股份	76,888.00	0.16
18	000725	京东方 A	75,967.00	0.15
19	000651	格力电器	63,727.00	0.13
20	002461	珠江啤酒	54,712.00	0.11

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）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	5,003,282.60
卖出股票收入（成交）总额	4,955,921.70

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。



## 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

无。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体出现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、处罚的情形披露如下：

2023 年 9 月 8 日，国家外汇管理局宁波市分局公示甬外管罚[2023]8 号行政处罚决定书，给予宁波银行罚款 670 万元，没收违法所得 183.02 万元人民币罚款的行政处罚。

2023 年 12 月 1 日，国家金融监督管理总局宁波监管局公示甬金罚决字[2023]24 号行政处罚决定书，给予宁波银行股份有限公司 520 万元人民币罚款的行政处罚。

2023 年 12 月 1 日，国家金融监督管理总局宁波监管局公示甬金罚决字[2023]26 号行政处罚决定书，给予宁波银行股份有限公司 100 万元人民币罚款的行政处罚。

2024 年 6 月 21 日，国家金融监督管理总局宁波监管局公示甬金罚决字[2024]56 号行政处罚决定书，给予宁波银行股份有限公司 65 万元人民币罚款的行政处罚。

2023 年 7 月 7 日，央行公示银罚决字【2023】55-67 号行政处罚决定书，给予平安银行股份有限公司没收违法所得 1848.67 元，罚款 3492.5 万元人民币罚款的行政处罚。

2023 年 12 月 15 日，国家金融监督管理总局深圳监管局公示深金罚决字[2023]69 号行政处罚决定书，给予平安银行股份有限公司 170 万元人民币罚款的行政处罚。

2024 年 5 月 17 日，国家金融监督管理总局公示金罚决字[2024]6 号行政处罚决定书，给予平安银行股份有限公司罚没共计 6073.98 万元人民币的行政处罚。

本基金遵循指数化投资理念，绝大部分资产采用完全复制法跟踪指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。本基金对上述主体发行证券的投资遵守本基金管理人基金投资管理相关制度及被动式指数化投资策略。

除上述主体外,本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期没有出现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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 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	2,645.83
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,645.83

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.12.5 期末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

无。

#### 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

无。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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 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 (%)
360	78,693.59	27,023,511.00	95.39	1,306,182.00	4.61

## 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（%）
中国农业银行—交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金	26,402,500.00	93.20

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国农业银行—交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金	26,402,500.00	93.20
2	华泰证券股份有限公司	591,011.00	2.09
3	潘菲	210,800.00	0.74
4	周国民	83,068.00	0.29
5	金淦波	72,726.00	0.26
6	孙海娥	50,000.00	0.18
7	高山	44,010.00	0.16
8	佟勤	41,000.00	0.14
9	徐培克	40,000.00	0.14
10	王曙华	34,000.00	0.12

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00

## 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

无。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年9月22日）基金份额总额	332,329,693.00
本报告期期初基金份额总额	26,829,693.00
本报告期基金总申购份额	8,700,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	7,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	28,329,693.00

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、基金管理人的重大人事变动：本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内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

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

### 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 (%)	
银河证券	1	9,959,204.30	100.00	7,329.19	100.00	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

#### 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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	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 (%)
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

### 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	深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 1 月 20 日
2	深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 3 月 29 日
3	交银施罗德基金管理有限公司高级管理人员任职公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 3 月 30 日
4	深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 4 月 20 日
5	交银施罗德基金管理有限公司关于终止上海钜派钰茂基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 5 月 23 日
6	深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 6 月 27 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 (%)
中国农业银行	1	2024/1/1-2024/6/30	25,202,500.00	1,200,000.00	-	26,402,500.00	93.20

一交银施罗德深证 300 价值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>本基金是交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金的目标 ETF。交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金遵循指数化投资理念，以目标 ETF 为主要投资对象，正常情况下投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%。本基金本报告期内除上述联接基金外未出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额 20%的情况。</p>						

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

### 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、中国证监会核准深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或

复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：[services@jysld.com](mailto:services@jysld.com)。