

深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 08 月 31 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 2021 年 8 月 27 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 2021 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
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	50
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 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
7.8 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	51
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	51

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
§ 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情况.....	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 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）	52,748,991.00
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

注：本基金扩位证券简称为深 300ETF。

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，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准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，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
业绩比较基准	深证 300 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、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	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(2021年01月01日 - 2021年06月30日)
本期已实现收益	9,964,382.32
本期利润	6,095,792.18
加权平均基金份额本期利润	0.1086
本期加权平均净值利润率	5.42%
本期基金份额净值增长率	4.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年06月30日)
期末可供分配利润	44,228,921.74
期末可供分配基金份额利润	0.8385
期末基金资产净值	110,045,949.67
期末基金份额净值	2.0862

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	108.62%

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④	①—③	②—④
过去一个月	1.05%	1.04%	0.76%	1.05%	0.29%	-0.01%
过去三个月	10.65%	1.13%	10.29%	1.14%	0.36%	-0.01%
过去六个月	4.92%	1.52%	4.75%	1.53%	0.17%	-0.01%
过去一年	29.73%	1.51%	29.63%	1.52%	0.10%	-0.01%
过去三年	71.39%	1.56%	69.46%	1.58%	1.93%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	108.62%	1.58%	96.34%	1.61%	12.28%	-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，公司注册资本金为132,724,224元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，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。

2021 上半年，汇添富基金新成立 21 只公开募集证券投资基金，包括 7 只股票型基金、13 只混合型基金、1 只债券型基金。截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 189 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		14	<p>国籍:中国。学历:北京大学中国经济研究中心金融学硕士。从业资格: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证券投资基金(LOF)的基金经理。2014年3月6日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金(QDII-LOF)的基金经理。2015年1月6日至今任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015年1月6日至今任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年5月26日至2016年7月13日任汇添富香港优势精选混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月</p>

					29 日至今任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 5 月 18 日至今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。2017 年 11 月 24 日至今任汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。
过蓓蓓	本基金的基金经理	2015 年 08 月 18 日		10	<p>国籍:中国。学历:中国科学技术大学金融工程博士。从业资格: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。</p> <p>2015 年 8 月 3 日至今任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的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的</p>

				<p>基金经理。2015 年 8 月 18 日至今任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至今任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）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型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 10 月 23 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月 26 日至今任汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 4 月 15 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经</p>
--	--	--	--	---

					理。2021 年 6 月 3 日至今任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”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:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在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合规守信情况的说明

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

本基金管理人通过建立嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人进一步完善了公司内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略及投资品种。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统内的公平交易模块进行操作,实现事前和事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的溢价率进行了T分布检验。对于没有通过检验的交易,再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、根据交易价格、交易频率、交易数量等对不同组合之间的反向交易进行了综合分析。

通过上述管控措施的有效落实,本报告期内,本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易,也未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

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 14 次,投资组合经理因投资组合的投资策略与其他组合发生同日反向交易,相关交易事前严格根据公司内部规定进行审批,事后对其交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析,未发现可能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

2021 年上半年市场风格剧烈,春节前延续 2020 年大盘成长风格,春节后阶段性切换为周期价值,二季度又切换为中小盘成长。市场整体活跃度较 2020 年提升,成交量屡超万亿,港股市场在一季度也迎来大量南下资金增持。

国内资金面从紧到松,而海外美国 10 年期国债收益率也由升转为缓降,二季度初美债利率企稳,长端利率回落。虽然原材料价格上涨,造成通胀上升的预期,但上半年货币整体保持宽松,主要是因为各个经济体对于经济复苏持续性保持怀疑,疫情也间断发生,使得各国央行并没有快速收紧流动性的动力。

A 股板块分化明显,前些年机构重仓的消费、医药板块分歧加大,上半年波动增加。而以新能源、新能源车、芯片为代表的科技成长板块获得资金的偏好,涨幅较大。究其原因,稳健、确定性为特征的行业在过去几年估值水平提高较多,机构持仓风格也较多的偏向此类行业,而当疫情造成流动性宽松并带来高弹性复苏时,这些行业对新资金的吸引力明显弱于估值尚不高、业绩预期高增长的成长股。于是,在 2021 年上半年演绎了极致的持仓调整。尤其是当新产业趋势、国家政策支持、全球需求启动三重因素叠加影响时,无论是从逻辑还是基本上,似乎都印证了需要配置的理由,当市场资金不那么紧缺时,对于趋势的跟随程度会更加激烈。

半年度末再看消费、医药板块,其估值水平回到近 5 年 70%分位数,而新能源、芯片则从 30%分位数回到近 10 年 80%分位数左右。如果考虑各行业盈利预期,则医药、新能源、芯片市盈率水平相近,高于消费行业估值,而消费行业市盈率则接近其历史上相对舒适的区

域。虽然估值分位数并不完全是一个有投资逻辑和投资价值的参考指标，指数成分在 10 年里的变动使得历史并不具备绝对的参考意义，但是估值高低在一定程度上反映了投资者的风险偏好，是选择高景气板块还是选择稳健确定性板块。

深证 300 指数今年上半年上涨 4.75%。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，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 4.92%。同期业绩比较基准收益率为 4.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然特殊时期的宽松政策未来会在一定程度上退出，但经济体对流动性的依赖在一次次的宽松中越来越强，因此，这种退出将会是很缓慢和充满博弈的过程。政府对于预期的管理、市场的反应、经济指标的变化将互相产生影响。对于下半年的投资环境，总体可以保持一定乐观态度，但需要紧密跟踪当前高景气板块的成长性和盈利能力的预期变化，以及这些板块与上半年调整板块之间投资性价比的变化，尤其是四季度市场资金寻求风格切换的特征一般较为明显。

但是，由产业逻辑驱动、国家政策支持的方向变化的概率极低，股价的涨跌也就会围绕着产业成长带来的基本面价值中枢变动。从三年的维度来看当前高景气板块，也依然是一个值得布局的方向，只不过这其中的波动将会随着资金的涌入而加大。以一个更长的视角来决策自身的投资标的是较好的选择，另外，下半年从极致化配置单一行业主题逐渐切换至较为均衡的状态也是降低组合波动较好的思路。

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。

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 2021 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：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	398,301.19	542,543.16
结算备付金		24,479.06	5,894.12
存出保证金		970.09	806.08
交易性金融资产	6.4.7.2	109,787,443.43	114,187,110.86
其中：股票投资		109,761,478.00	114,187,110.86
基金投资		-	-
债券投资		25,965.43	-
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		23,741.98	2,683.22
应收利息	6.4.7.5	66.57	83.93
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		110,235,002.32	114,739,121.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 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		148.31	144.19

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		46,670.06	49,764.28
应付托管费		9,334.00	9,952.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,640.13	-
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	124,260.15	250,000.00
负债合计		189,052.65	309,861.34
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	52,748,991.00	57,548,991.00
未分配利润	6.4.7.1 0	57,296,958.67	56,880,269.03
所有者权益合计		110,045,949.67	114,429,260.03
负债和所有者权益总计		110,235,002.32	114,739,121.37

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.0862 元，基金份额总额 52,748,991.00 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：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
一、收入		6,609,658.12	17,398,105.07
1. 利息收入		1,347.18	2,494.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,314.49	2,414.13
债券利息收入		32.69	80.62
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）		10,475,355.08	9,911,643.75
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,830,581.71	8,949,394.45
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	50,949.35	82,826.31
资产支持证券投资收益	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	593,824.02	879,422.99
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-3,868,590.14	7,477,522.57
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	1,546.00	6,444.00
减：二、费用		513,865.94	578,840.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	279,654.91	284,486.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	55,931.00	56,897.21
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	18,923.80	24,639.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.08	0.19
7. 其他费用	6.4.7.21	159,356.15	212,818.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,095,792.18	16,819,264.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,095,792.18	16,819,264.09

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：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 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）	57,548,991.00	56,880,269.03	114,429,260.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,095,792.18	6,095,792.18
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）	-4,800,000.00	-5,679,102.54	-10,479,102.54

其中：1. 基金申购款	9,600,000.00	9,240,588.07	18,840,588.07
2. 基金赎回款	-14,400,000.00	-14,919,690.61	-29,319,690.61
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）	52,748,991.00	57,296,958.67	110,045,949.67
项目	上年度可比期间 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

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：

张暉	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）、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、股指期货、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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 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费附加的单位外）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暂免征收个人所得税的通知》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 2021 年 06 月 30 日
活期存款	398,301.19
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	398,301.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	75,778,741.36	109,761,478.00	33,982,736.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	25,965.43	4,865.43
	银行间市场	-	-
	其他	-	-
	合计	25,965.43	4,865.43
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	75,799,841.36	109,787,443.43	33,987,602.07

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 2021年06月30日
应收活期存款利息	62.43
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1.44
应收债券利息	2.34
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	0.36
合计	66.57

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 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	8,640.13
银行间市场应付交易费用	-
合计	8,640.13

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	29,752.78
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	35,000.00

应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	124,260.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,548,991.00	57,548,991.00
本期申购	9,600,000.00	9,600,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-14,400,000.00	-14,400,000.00
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	52,748,991.00	52,748,991.00

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	37,863,320.88	19,016,948.15	56,880,269.03
本期利润	9,964,382.32	-3,868,590.14	6,095,792.18
本期基金份额交易产生的变动数	-3,598,781.46	-2,080,321.08	-5,679,102.54
其中：基金申购款	7,068,332.26	2,172,255.81	9,240,588.07
基金赎回款	-10,667,113.72	-4,252,576.89	-14,919,690.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,228,921.74	13,068,036.93	57,296,958.67

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	1,208.42

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	99.48
其他	6.59
合计	1,314.49

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
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,184,437.18
股票投资收益——赎回差价收入	8,646,144.53
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	9,830,581.71

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
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	6,408,445.00
减：卖出股票成本总额	5,224,007.82
买卖股票差价收入	1,184,437.18

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
	2021年01月01日至2021年06月30日
赎回基金份额对价总额	29,319,690.61
减：现金支付赎回款总额	1,491,806.61
减：赎回股票成本总额	19,181,739.47
赎回差价收入	8,646,144.53

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
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	316,380.40

交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成本总额	265,400.00
减：应收利息总额	31.05
买卖债券差价收入	50,949.35

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 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	593,824.02
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	593,824.02

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-3,868,590.14
——股票投资	-3,873,455.57
——债券投资	4,865.43
——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	-3,868,590.14

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,546.00
其他	-
合计	1,546.00

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	18,923.80
银行间市场交易费用	-
合计	18,923.80

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	96.00
指数使用费	70,000.00
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	159,356.15

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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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	12,502,006.00	100.00	16,095,842.15	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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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	316,380.40	100.00	334,210.85	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 2021 年 01 月 01 日至 2021 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	11,392.92	100.00	8,640.13	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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

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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	279,654.91	284,486.05
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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	55,931.00	56,897.21

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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	398,301.19	1,208.42	728,492.74	2,294.17

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：本基金本报告期末未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

6.4.12 期末（2021 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

金额单位：人民币元

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	流通受限类型	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
					-	-	-	-	-	
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
123117	健帆转债	2021 年 06 月 23 日	2021 年 07 月 12 日	新债流通受限	100.00	100.00	54	5,400.00	5,400.00	

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	停牌日期	停牌原	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	-----	------	-----	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

	称		因						
002024	苏宁易购	2021年06月16日	重大资产重组	5.59	2021年07月06日	6.15	38,425	400,248.61	214,795.75

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 2021 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证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 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证券款余额。

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 2021 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同责任，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。

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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 06 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	398,301.19	-	-	-	-	-	398,301.19
结算备付金	24,479.06	-	-	-	-	-	24,479.06
存出保证金	970.09	-	-	-	-	-	970.09
交易性金融资产	-	-	25,965.43	-	-	109,761,478.00	109,787,443.43
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	66.57	66.57
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	23,741.98	23,741.98
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	423,750.34	-	25,965.43	-	-	109,785,286.55	110,235,002.32
负债							
应付	-	-	-	-	-	-	-

赎回款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	46,670.06	46,670.06
应付托管费	-	-	-	-	-	9,334.00	9,334.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	148.31	148.31
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,640.13	8,640.13
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	124,260.15	124,260.15
负债总计	-	-	-	-	-	189,052.65	189,052.65
利率敏感度缺口	423,750.34	-	25,965.43	-	-	109,596,233.90	110,045,949.67
上年度末 2020 年 12 月 31	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

日							
资产							
银行存款	542,543.16	-	-	-	-	-	542,543.16
结算备付金	5,894.12	-	-	-	-	-	5,894.12
存出保证金	806.08	-	-	-	-	-	806.08
交易性金融资产	-	-	-	-	-	114,187,110.86	114,187,110.86
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	83.93	83.93
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,683.22	2,683.22
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	549,243.36	-	-	-	-	114,189,878.01	114,739,121.37
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	49,764.28	49,764.28

应付托管费	-	-	-	-	-	9,952.87	9,952.87
应付证券清算款	-	-	-	-	-	144.19	144.19
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	250,000.00	250,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	309,861.34	309,861.34
利率敏感度缺口	549,243.36	-	-	-	-	113,880,016.67	114,429,260.03

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：利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转债债券和可交换债券。因此，除在交易所交易的可转换债券和可交换债券外，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

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 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 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	109,761,478.00	99.74	114,187,110.86	99.79
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	25,965.43	0.02	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	109,787,443.43	99.77	114,187,110.86	99.79

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。

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 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	深证 300 指数下跌 5%	-5,470,357.70	-5,686,752.22
	深证 300 指数上涨 5%	5,470,357.70	5,686,752.22

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	109,761,478.00	99.57
	其中：股票	109,761,478.00	99.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	25,965.43	0.02
	其中：债券	25,965.43	0.02
	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	422,780.25	0.38
8	其他资产	24,778.64	0.02
9	合计	110,235,002.32	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	2,292,872.91	2.08
B	采矿业	495,555.31	0.45
C	制造业	79,859,933.39	72.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	362,220.08	0.33

E	建筑业	104,718.24	0.10
F	批发和零售业	698,792.68	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	1,386,804.98	1.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,833,260.22	5.30
J	金融业	9,033,846.82	8.21
K	房地产业	2,836,712.46	2.58
L	租赁和商务服务业	1,296,865.48	1.18
M	科学研究和技术服务业	1,107,319.00	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	271,924.51	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	256,947.00	0.23
Q	卫生和社会工作	2,853,795.62	2.59
R	文化、体育和娱乐业	766,042.66	0.70
S	综合	303,866.64	0.28
	合计	109,761,478.00	99.74

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	300750	宁德时代	10,600	5,668,880.00	5.15
2	000858	五粮液	17,468	5,203,542.52	4.73
3	000333	美的集团	46,684	3,331,837.08	3.03
4	300059	东方财富	75,717	2,482,760.43	2.26
5	002415	海康威视	38,311	2,471,059.50	2.25
6	000651	格力电器	45,148	2,352,210.80	2.14
7	300760	迈瑞医疗	4,100	1,968,205.00	1.79
8	002594	比亚迪	7,793	1,956,043.00	1.78
9	002475	立讯精密	42,288	1,945,248.00	1.77
10	000001	平安银行	80,721	1,825,909.02	1.66

11	000725	京东方 A	269,908	1,684,225.92	1.53
12	000568	泸州老窖	7,122	1,680,364.68	1.53
13	300015	爱尔眼科	21,473	1,524,153.54	1.39
14	000002	万 科 A	63,998	1,523,792.38	1.38
15	002714	牧原股份	22,489	1,367,780.98	1.24
16	300122	智飞生物	6,700	1,251,091.00	1.14
17	002142	宁波银行	30,782	1,199,574.54	1.09
18	300124	汇川技术	15,552	1,154,891.52	1.05
19	300014	亿纬锂能	10,818	1,124,314.74	1.02
20	000661	长春高新	2,890	1,118,430.00	1.02
21	002230	科大讯飞	16,385	1,107,298.30	1.01
22	002304	洋河股份	5,283	1,094,637.60	0.99
23	300274	阳光电源	9,100	1,047,046.00	0.95
24	300782	卓胜微	1,936	1,040,600.00	0.95
25	002352	顺丰控股	15,200	1,029,040.00	0.94
26	002812	恩捷股份	4,330	1,013,653.00	0.92
27	002241	歌尔股份	22,290	952,674.60	0.87
28	300347	泰格医药	4,850	937,505.00	0.85
29	000063	中兴通讯	28,183	936,521.09	0.85
30	002460	赣锋锂业	7,700	932,393.00	0.85
31	002027	分众传媒	98,788	929,595.08	0.84
32	300142	沃森生物	14,800	913,160.00	0.83
33	000100	TCL 科技	114,915	879,099.75	0.80
34	002271	东方雨虹	15,770	872,396.40	0.79
35	002129	中环股份	20,329	784,699.40	0.71
36	000338	潍柴动力	41,024	733,098.88	0.67
37	300498	温氏股份	45,697	656,665.89	0.60
38	002410	广联达	9,353	637,874.60	0.58
39	002049	紫光国微	4,061	626,165.59	0.57
40	002311	海大集团	7,494	611,510.40	0.56
41	002371	北方华创	2,100	582,498.00	0.53
42	002709	天赐材料	5,380	573,400.40	0.52
43	000799	酒鬼酒	2,200	562,320.00	0.51
44	002821	凯莱英	1,500	558,900.00	0.51
45	300450	先导智能	9,206	553,648.84	0.50
46	000538	云南白药	4,658	539,023.76	0.49
47	002493	荣盛石化	29,150	503,420.50	0.46
48	300454	深信服	1,900	493,012.00	0.45
49	000625	长安汽车	18,481	485,680.68	0.44
50	300408	三环集团	10,900	462,378.00	0.42
51	300759	康龙化成	2,100	455,679.00	0.41
52	300595	欧普康视	4,320	447,336.00	0.41
53	300496	中科创达	2,800	439,768.00	0.40

54	300601	康泰生物	2,900	432,100.00	0.39
55	300413	芒果超媒	6,260	429,436.00	0.39
56	300012	华测检测	13,000	414,440.00	0.38
57	000776	广发证券	27,092	410,172.88	0.37
58	002050	三花智控	16,956	406,604.88	0.37
59	002179	中航光电	5,080	401,421.60	0.36
60	002074	国轩高科	9,087	395,829.72	0.36
61	300896	爱美客	500	394,440.00	0.36
62	000166	申万宏源	84,206	394,084.08	0.36
63	002340	格林美	42,103	393,663.05	0.36
64	002841	视源股份	3,100	385,299.00	0.35
65	000157	中联重科	41,643	384,781.32	0.35
66	300433	蓝思科技	12,619	371,124.79	0.34
67	002001	新 和 成	12,837	368,165.16	0.33
68	002601	龙蟠佰利	10,600	366,548.00	0.33
69	300661	圣邦股份	1,425	360,140.25	0.33
70	300285	国瓷材料	7,300	355,875.00	0.32
71	300529	健帆生物	4,110	354,939.60	0.32
72	300003	乐普医疗	10,906	350,300.72	0.32
73	002568	百润股份	3,660	346,931.40	0.32
74	002236	大华股份	16,245	342,769.50	0.31
75	000963	华东医药	7,373	339,231.73	0.31
76	300999	金龙鱼	3,900	331,344.00	0.30
77	002008	大族激光	8,140	328,774.60	0.30
78	000786	北新建材	8,344	327,502.00	0.30
79	000895	双汇发展	10,218	324,932.40	0.30
80	000768	中航西飞	12,320	323,769.60	0.29
81	001979	招商蛇口	28,771	315,042.45	0.29
82	002185	华天科技	20,277	312,063.03	0.28
83	300207	欣旺达	9,500	309,320.00	0.28
84	002007	华兰生物	8,377	307,268.36	0.28
85	000009	中国宝安	16,632	303,866.64	0.28
86	000876	新 希 望	20,306	297,889.02	0.27
87	002202	金风科技	24,176	293,980.16	0.27
88	000301	东方盛虹	14,000	292,600.00	0.27
89	002736	国信证券	27,175	292,131.25	0.27
90	000596	古井贡酒	1,200	287,400.00	0.26
91	002624	完美世界	12,000	286,920.00	0.26
92	000938	紫光股份	12,958	283,521.04	0.26
93	300316	晶盛机电	5,500	277,750.00	0.25
94	002555	三七互娱	11,500	276,230.00	0.25
95	000069	华侨城 A	34,881	259,514.64	0.24
96	002607	中公教育	12,300	256,947.00	0.23

97	000977	浪潮信息	9,111	256,292.43	0.23
98	000425	徐工机械	39,798	253,513.26	0.23
99	002625	光启技术	12,100	251,801.00	0.23
100	300253	卫宁健康	15,441	251,225.07	0.23
101	002384	东山精密	12,050	251,122.00	0.23
102	000783	长江证券	33,999	248,872.68	0.23
103	000066	中国长城	16,836	245,805.60	0.22
104	002459	晶澳科技	5,000	245,000.00	0.22
105	300037	新宙邦	2,400	240,240.00	0.22
106	002044	美年健康	26,228	238,937.08	0.22
107	300558	贝达药业	2,200	238,128.00	0.22
108	300136	信维通信	7,700	237,776.00	0.22
109	300676	华大基因	2,000	237,200.00	0.22
110	300677	英科医疗	1,900	237,120.00	0.22
111	002405	四维图新	16,091	236,537.70	0.21
112	002138	顺络电子	6,100	236,497.00	0.21
113	002797	第一创业	33,120	236,476.80	0.21
114	000988	华工科技	9,946	233,929.92	0.21
115	300146	汤臣倍健	7,088	233,195.20	0.21
116	300033	同花顺	2,032	229,168.96	0.21
117	000547	航天发展	12,033	227,062.71	0.21
118	002353	杰瑞股份	5,011	223,991.70	0.20
119	300144	宋城演艺	13,276	223,036.80	0.20
120	002252	上海莱士	28,913	216,558.37	0.20
121	002024	苏宁易购	38,425	214,795.75	0.20
122	002223	鱼跃医疗	5,626	214,519.38	0.19
123	002791	坚朗五金	1,100	213,455.00	0.19
124	300628	亿联网络	2,500	209,500.00	0.19
125	000703	恒逸石化	17,510	209,244.50	0.19
126	002920	德赛西威	1,900	209,152.00	0.19
127	300724	捷佳伟创	1,800	208,818.00	0.19
128	002508	老板电器	4,490	208,785.00	0.19
129	002600	领益智造	22,700	208,613.00	0.19
130	000728	国元证券	25,948	206,805.56	0.19
131	002414	高德红外	7,380	203,540.40	0.18
132	000807	云铝股份	16,900	201,110.00	0.18
133	002444	巨星科技	5,900	201,072.00	0.18
134	002602	世纪华通	31,076	199,507.92	0.18
135	300699	光威复材	2,600	197,470.00	0.18
136	000860	顺鑫农业	4,650	196,137.00	0.18
137	002156	通富微电	8,100	194,724.00	0.18
138	002030	达安基因	9,100	193,284.00	0.18
139	300223	北京君正	1,900	191,748.00	0.17

140	002013	中航机电	18,908	190,403.56	0.17
141	002439	启明星辰	6,420	186,244.20	0.17
142	002212	天融信	9,400	185,838.00	0.17
143	002064	华峰化学	13,000	184,600.00	0.17
144	300308	中际旭创	4,780	184,125.60	0.17
145	002180	纳思达	5,700	183,540.00	0.17
146	002078	太阳纸业	13,700	182,895.00	0.17
147	002916	深南电路	1,640	182,253.20	0.17
148	300751	迈为股份	400	181,880.00	0.17
149	000630	铜陵有色	66,235	180,159.20	0.16
150	002385	大北农	26,287	178,751.60	0.16
151	000656	金科股份	30,613	177,249.27	0.16
152	002507	涪陵榨菜	4,700	177,002.00	0.16
153	002422	科伦药业	8,816	175,879.20	0.16
154	002938	鹏鼎控股	4,900	175,812.00	0.16
155	002463	沪电股份	11,300	174,811.00	0.16
156	300618	寒锐钴业	2,200	173,448.00	0.16
157	002080	中材科技	6,600	172,722.00	0.16
158	000513	丽珠集团	3,443	172,218.86	0.16
159	000708	中信特钢	8,200	170,888.00	0.16
160	002511	中顺洁柔	6,200	170,810.00	0.16
161	000739	普洛药业	5,800	170,520.00	0.15
162	002409	雅克科技	2,100	170,100.00	0.15
163	003816	中国广核	62,700	167,409.00	0.15
164	002456	欧菲光	18,595	165,123.60	0.15
165	002127	南极电商	16,800	164,136.00	0.15
166	002075	沙钢股份	14,900	162,559.00	0.15
167	000423	东阿阿胶	4,500	161,595.00	0.15
168	300832	新产业	2,600	160,160.00	0.15
169	300088	长信科技	19,248	158,988.48	0.14
170	000021	深科技	8,300	158,862.00	0.14
171	000050	深天马 A	11,103	157,440.54	0.14
172	300001	特锐德	5,200	156,572.00	0.14
173	002120	韵达股份	11,566	156,487.98	0.14
174	002373	千方科技	9,300	155,310.00	0.14
175	000932	华菱钢铁	23,480	154,968.00	0.14
176	002157	正邦科技	12,900	154,155.00	0.14
177	300357	我武生物	2,400	153,888.00	0.14
178	002465	海格通信	16,230	153,535.80	0.14
179	000825	太钢不锈	20,465	153,282.85	0.14
180	300244	迪安诊断	4,000	153,200.00	0.14
181	000983	山西焦煤	18,401	152,912.31	0.14
182	002603	以岭药业	5,200	151,632.00	0.14

183	300009	安科生物	10,172	151,562.80	0.14
184	300747	锐科激光	1,325	151,129.50	0.14
185	300383	光环新网	10,500	151,095.00	0.14
186	300463	迈克生物	3,500	147,315.00	0.13
187	000975	银泰黄金	15,300	145,503.00	0.13
188	002152	广电运通	11,160	145,414.80	0.13
189	000960	锡业股份	9,025	144,670.75	0.13
190	002673	西部证券	17,302	142,741.50	0.13
191	000750	国海证券	33,549	142,247.76	0.13
192	002065	东华软件	17,760	140,836.80	0.13
193	300296	利亚德	18,000	140,760.00	0.13
194	000998	隆平高科	8,548	137,109.92	0.12
195	000723	美锦能源	18,100	136,836.00	0.12
196	300070	碧水源	18,621	136,119.51	0.12
197	300482	万孚生物	2,070	133,908.30	0.12
198	002926	华西证券	13,900	133,857.00	0.12
199	002151	北斗星通	3,100	133,517.00	0.12
200	300271	华宇软件	6,900	132,825.00	0.12
201	002299	圣农发展	5,499	131,316.12	0.12
202	000623	吉林敖东	8,361	129,511.89	0.12
203	002572	索菲亚	5,300	128,260.00	0.12
204	002430	杭氧股份	3,700	127,983.00	0.12
205	000878	云南铜业	9,923	127,312.09	0.12
206	002131	利欧股份	54,400	127,296.00	0.12
207	000617	中油资本	21,000	126,420.00	0.11
208	002500	山西证券	18,684	125,369.64	0.11
209	002382	蓝帆医疗	6,000	125,100.00	0.11
210	002557	洽洽食品	2,900	124,990.00	0.11
211	002690	美亚光电	2,200	122,672.00	0.11
212	002683	宏大爆破	4,400	122,188.00	0.11
213	002626	金达威	2,700	120,690.00	0.11
214	300024	机器人	11,184	119,333.28	0.11
215	002019	亿帆医药	6,900	119,025.00	0.11
216	002966	苏州银行	16,100	118,335.00	0.11
217	000997	新大陆	7,110	117,954.90	0.11
218	300058	蓝色光标	19,048	115,240.40	0.10
219	002958	青农商行	26,700	114,276.00	0.10
220	300251	光线传媒	10,506	113,569.86	0.10
221	000738	航发控制	5,448	113,481.84	0.10
222	300017	网宿科技	19,334	113,103.90	0.10
223	000686	东北证券	13,304	112,418.80	0.10
224	000027	深圳能源	12,163	111,534.71	0.10
225	002294	信立泰	3,302	108,635.80	0.10

226	002506	协鑫集成	31,200	108,576.00	0.10
227	300773	拉卡拉	3,800	107,274.00	0.10
228	002831	裕同科技	3,560	105,696.40	0.10
229	002372	伟星新材	5,100	105,417.00	0.10
230	002558	巨人网络	7,900	105,070.00	0.10
231	300418	昆仑万维	6,400	104,832.00	0.10
232	002081	金螳螂	13,222	104,718.24	0.10
233	000961	中南建设	17,440	103,244.80	0.09
234	002056	横店东磁	7,900	102,700.00	0.09
235	000401	冀东水泥	8,300	102,505.00	0.09
236	300212	易华录	3,800	102,258.00	0.09
237	002032	苏泊尔	1,600	102,064.00	0.09
238	002153	石基信息	4,333	101,868.83	0.09
239	000581	威孚高科	4,877	101,587.91	0.09
240	002595	豪迈科技	3,800	101,460.00	0.09
241	000540	中天金融	37,064	101,184.72	0.09
242	000709	河钢股份	39,800	97,908.00	0.09
243	002939	长城证券	8,700	96,831.00	0.09
244	000671	阳光城	18,605	96,746.00	0.09
245	000999	华润三九	3,512	93,946.00	0.09
246	002281	光迅科技	3,800	93,480.00	0.08
247	002010	传化智联	11,400	87,894.00	0.08
248	002925	盈趣科技	2,250	87,547.50	0.08
249	002146	荣盛发展	15,505	87,448.20	0.08
250	002745	木林森	6,500	87,100.00	0.08
251	300748	金力永磁	2,720	86,033.60	0.08
252	000883	湖北能源	18,143	83,276.37	0.08
253	000729	燕京啤酒	11,476	83,086.24	0.08
254	000800	一汽解放	7,600	82,232.00	0.07
255	002563	森马服饰	6,800	81,260.00	0.07
256	000629	攀钢钒钛	35,100	80,379.00	0.07
257	002936	郑州银行	21,680	79,565.60	0.07
258	002242	九阳股份	2,400	77,976.00	0.07
259	002867	周大生	3,850	76,114.50	0.07
260	002266	浙富控股	15,100	75,349.00	0.07
261	002128	露天煤业	7,200	74,952.00	0.07
262	300188	美亚柏科	4,200	73,080.00	0.07
263	000930	中粮科技	8,100	72,981.00	0.07
264	002670	国盛金控	6,400	72,896.00	0.07
265	000987	越秀金控	5,700	72,162.00	0.07
266	000898	鞍钢股份	15,940	70,933.00	0.06
267	002773	康弘药业	3,030	70,083.90	0.06
268	002110	三钢闽光	10,350	69,759.00	0.06

269	001914	招商积余	4,000	68,720.00	0.06
270	002705	新宝股份	2,600	68,250.00	0.06
271	000089	深圳机场	8,700	67,599.00	0.06
272	300866	安克创新	400	66,988.00	0.06
273	000402	金融街	9,880	66,690.00	0.06
274	000990	诚志股份	5,100	64,923.00	0.06
275	000559	万向钱潮	11,768	62,488.08	0.06
276	300888	稳健医疗	500	61,810.00	0.06
277	300741	华宝股份	1,200	60,864.00	0.06
278	000967	盈峰环境	8,800	60,456.00	0.05
279	001965	招商公路	8,000	57,760.00	0.05
280	000951	中国重汽	2,100	56,826.00	0.05
281	000627	天茂集团	15,516	56,167.92	0.05
282	300841	康华生物	200	53,760.00	0.05
283	000028	国药一致	1,355	51,273.20	0.05
284	002216	三全食品	3,020	49,739.40	0.05
285	300783	三只松鼠	1,000	47,360.00	0.04
286	000785	居然之家	7,600	46,132.00	0.04
287	000959	首钢股份	7,500	42,150.00	0.04
288	002399	海普瑞	2,600	41,418.00	0.04
289	002468	申通快递	5,300	40,386.00	0.04
290	002461	珠江啤酒	3,400	37,196.00	0.03
291	000031	大悦城	10,300	37,080.00	0.03
292	002653	海思科	1,700	36,584.00	0.03
293	002532	天山铝业	4,300	36,077.00	0.03
294	002945	华林证券	2,600	35,932.00	0.03
295	001872	招商港口	2,100	35,532.00	0.03
296	000046	泛海控股	14,918	34,311.40	0.03
297	002901	大博医疗	400	29,156.00	0.03
298	000958	东方能源	6,600	28,974.00	0.03
299	300869	康泰医学	400	28,328.00	0.03
300	002423	中粮资本	1,700	15,385.00	0.01

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	000799	酒鬼酒	560,529.00	0.49
2	300999	金龙鱼	379,478.00	0.33
3	300896	爱美客	306,216.00	0.27
4	300750	宁德时代	261,354.00	0.23
5	002444	巨星科技	210,685.00	0.18
6	300832	新产业	194,004.00	0.17
7	002415	海康威视	171,630.00	0.15
8	300751	迈为股份	161,880.00	0.14
9	300122	智飞生物	143,644.00	0.13
10	002607	中公教育	140,227.00	0.12
11	002812	恩捷股份	130,024.00	0.11
12	000661	长春高新	128,028.00	0.11
13	002430	杭氧股份	127,554.00	0.11
14	000063	中兴通讯	110,997.00	0.10
15	002493	荣盛石化	100,675.00	0.09
16	002459	晶澳科技	98,206.00	0.09
17	002129	中环股份	85,716.00	0.07
18	002920	德赛西威	84,207.00	0.07
19	000301	东方盛虹	77,353.00	0.07
20	002736	国信证券	70,910.00	0.06

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	002709	天赐材料	312,592.00	0.27
2	300999	金龙鱼	304,408.00	0.27
3	000333	美的集团	153,505.00	0.13
4	000651	格力电器	138,446.00	0.12
5	002594	比亚迪	131,444.00	0.11
6	000568	泸州老窖	128,262.00	0.11
7	300059	东方财富	119,361.00	0.10
8	002268	卫士通	116,593.60	0.10
9	002195	二三四五	114,021.20	0.10
10	300454	深信服	111,602.00	0.10
11	002396	星网锐捷	109,716.00	0.10
12	002371	北方华创	108,792.00	0.10
13	000001	平安银行	103,281.00	0.09
14	002142	宁波银行	89,198.00	0.08

15	002368	太极股份	85,246.00	0.07
16	000002	万科A	84,256.00	0.07
17	300803	指南针	83,650.00	0.07
18	300677	英科医疗	79,249.00	0.07
19	002217	合力泰	76,598.00	0.07
20	300770	新媒股份	75,709.00	0.07

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	6,093,561.00
卖出股票收入（成交）总额	6,408,445.00

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）	25,965.43	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,965.43	0.02

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	127036	三花转债	157	20,565.43	0.02
2	123117	健帆转债	54	5,400.00	0.00

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:本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,平安银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	970.09
2	应收证券清算款	23,741.98
3	应收股利	-
4	应收利息	66.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,778.64

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 (%)
2,651	19,897.77	35,185,433.00	66.70	17,563,558.00	33.30	34,214,142.00	64.86

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“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责任公司	708,499.00	1.34
2	汤淑娟	425,101.00	0.81
3	侯小蔓	363,900.00	0.69
4	吴淳欣	300,000.00	0.57
5	唐美杰	254,300.00	0.48
6	丘陵	250,000.00	0.47
7	苏州市城市建设开发有限公司	244,792.00	0.46
8	伞国颖	234,000.00	0.44
9	杜珏	230,000.00	0.44
10	孙家骏	229,100.00	0.43
11	中国工商银行股	34,214,142.00	64.86

	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		
--	------------------------------------	--	--

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	57,548,991.00
本报告期基金总申购份额	9,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	14,400,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	52,748,991.00

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，本基金管理人未发生重大人事变动。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理

人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	4	12,502,006.00	100.00	11,392.92	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 证券	1	-	-	-	-	
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	316,380.40	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，同一基金管理机构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	汇添富基金旗下 164 只基金 2020 年 4 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 01 月 22 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2020 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 03 月 30 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金修订的招募说明书、产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 02 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 22 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加第一创业为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 05 月 19 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 06 月 24 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	持有基金份额比例达到或者超过 20%的	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

		时间 区间					
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	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	40,614,142.00	-	6,400,000.00	34,214,142.00	64.86

产品特有风险

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。

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。

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

2021 年 08 月 31 日