

汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 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	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对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	41
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	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	49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	49
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	49
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	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	50

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 本报告期投资基金情况.....	50
7.13 投资组合报告附注.....	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.3 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.....	51
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	汇添富深证 300ETF 联接
基金主代码	470068
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 09 月 28 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)	37,240,612.23
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

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
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标 ETF，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	本基金以深证 300 交易型开放式指数证券投资基金作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。本基金主要以一级市场申购的方式投资于目标 ETF，获取基金份额净值上涨带来的收益；在目标 ETF 基金份额二级市场交易流动性较好的情况下，也可以通过二级市场买卖目标 ETF 的基金份额。本基金建仓时间为 6 个月，6 个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、目标 ETF 的投资策略。
业绩比较基准	深证 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

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
	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	《中国证券报》
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	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼

§ 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	5,135,161.64
本期利润	4,181,015.64
加权平均基金份额本期利润	0.1091
本期加权平均净值利润率	5.37%
本期基金份额净值增长率	4.64%
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	21,657,875.58
期末可供分配基金份额利润	0.5816
期末基金资产净值	78,417,967.16
期末基金份额净值	2.1057
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	110.57%

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	0.98%	0.99%	0.73%	1.00%	0.25%	-0.01%

个月						
过去三 个月	9.99%	1.07%	9.78%	1.09%	0.21%	-0.02%
过去六 个月	4.64%	1.44%	4.59%	1.45%	0.05%	-0.01%
过去一 年	28.04%	1.43%	28.15%	1.44%	-0.11%	-0.01%
过去三 年	67.77%	1.47%	65.86%	1.50%	1.91%	-0.03%
自基金 合同生 效日起 至今	110.57%	1.48%	99.82%	1.52%	10.75%	-0.04%

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联接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28日）起6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、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	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

					<p>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。</p> <p>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 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。</p>
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</p>

				<p>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</p>
--	--	--	--	--

					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。

半年度末再回看消费、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指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性，股票及标的 ETF 投资仓位在考察期内保持在 90%~95%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，基本实现了基金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 4.64%。同期业绩比较基准收益率为 4.59%。

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。

作为被动投资的指数型基金，汇添富深证 300ETF 联接基金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 6 次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

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托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、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汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 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：汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	4,320,815.25	4,795,342.37
结算备付金		9,950.24	27,787.32
存出保证金		4,848.21	6,785.42
交易性金融资产	6.4.7.2	74,204,580.04	83,247,309.95
其中：股票投资		2,827,037.00	2,490,150.00
基金投资		71,377,543.04	80,757,159.95
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	755,898.91
应收利息	6.4.7.5	375.25	480.69
应收股利		-	-
应收申购款		58,029.93	54,947.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		78,598,598.92	88,888,551.68
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		-	2,717.06
应付赎回款		106,039.35	944,858.74
应付管理人报酬		1,934.22	2,624.85
应付托管费		386.82	524.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,523.91	1,934.05
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	69,747.46	142,681.54
负债合计		180,631.76	1,095,341.20
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	37,240,612.23	43,625,181.44
未分配利润	6.4.7.1 0	41,177,354.93	44,168,029.04
所有者权益合计		78,417,967.16	87,793,210.48
负债和所有者权益总计		78,598,598.92	88,888,551.68

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.1057 元，基金份额总额 37,240,612.23 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
一、收入		4,297,840.05	11,130,235.38
1. 利息收入		7,947.23	15,839.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,947.23	15,839.07
债券利息收入		-	0.64
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）		5,198,947.43	2,810,488.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	266,939.88	297,168.45
基金投资收益	6.4.7.13	4,930,005.55	2,505,548.50
债券投资收益	6.4.7.14	-	630.07
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	2,002.00	7,141.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-954,146.00	8,215,366.91
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	45,091.39	88,540.67
减：二、费用		116,824.41	158,813.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,357.46	16,523.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,671.37	3,304.68
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	31,319.22	69,310.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	69,476.36	69,674.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,181,015.64	10,971,421.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,181,015.64	10,971,421.78

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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)	43,625,181.44	44,168,029.04	87,793,210.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,181,015.64	4,181,015.64
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)	-6,384,569.21	-7,171,689.75	-13,556,258.96
其中：1. 基金申购款	13,691,382.74	14,425,085.63	28,116,468.37
2. 基金赎回款	-20,075,951.95	-21,596,775.38	-41,672,727.33
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)	37,240,612.23	41,177,354.93	78,417,967.16
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)	62,445,895.70	26,889,217.13	89,335,112.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,971,421.78	10,971,421.78
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)	-13,562,773.60	-6,356,826.87	-19,919,600.47
其中：1. 基金申购款	34,555,130.38	16,236,563.37	50,791,693.75
2. 基金赎回款	-48,117,903.98	-22,593,390.24	-70,711,294.22

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）	48,883,122.10	31,503,812.04	80,386,934.14

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：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
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

汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（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 28 日正式生效，首次设立募集规模为 336,005,348.19 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与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，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、目标 ETF、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（但需符合中国证监会的相关规定）。本基金通过投资于目标 ETF、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 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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 2021 年 06 月 30 日
活期存款	4,320,815.25
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	4,320,815.25

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	2,824,125.00	2,827,037.00	2,912.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		45,516,972.09	71,377,543.04	25,860,570.95
其他		-	-	-
合计		48,341,097.09	74,204,580.04	25,863,482.95

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	369.22
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	4.05
应收债券利息	-
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	1.98
合计	375.25

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	2,523.91

银行间市场应付交易费用	-
合计	2,523.91

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	323.10
应付证券出借违约金	-
应付审计费	29,752.78
应付信息披露费	39,671.58
应付指数使用费	-
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	69,747.46

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	43,625,181.44	43,625,181.44
本期申购	13,691,382.74	13,691,382.74
本期赎回（以“-”号填列）	-20,075,951.95	-20,075,951.95
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	37,240,612.23	37,240,612.23

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	19,720,820.78	24,447,208.26	44,168,029.04

本期利润	5,135,161.64	-954,146.00	4,181,015.64
本期基金份额交易产生的变动数	-3,198,106.84	-3,973,582.91	-7,171,689.75
其中：基金申购款	7,369,422.63	7,055,663.00	14,425,085.63
基金赎回款	-10,567,529.47	-11,029,245.91	-21,596,775.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,657,875.58	19,519,479.35	41,177,354.93

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		7,864.33
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		33.32
其他		49.58
合计		7,947.23

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		266,939.88
股票投资收益——赎回差价收入		-
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		266,939.88

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		14,639,075.35
减：卖出股票成本总额		14,372,135.47
买卖股票差价收入		266,939.88

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
申购基金份额总额		-

减：现金支付申购款总额	-
减：申购股票成本总额	-
申购差价收入	-

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	13,444,280.79
减：卖出/赎回基金成本总额	8,514,275.24
基金投资收益	4,930,005.55

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

注：本基金本报告期无债券投资收益。

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	2,002.00
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	2,002.00

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	-954,146.00
——股票投资	-88,804.33
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-865,341.67

——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	-954, 146. 00

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	45, 091. 39
替代损益	-
其他	-
合计	45, 091. 39

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	31, 319. 22
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
转换费	-
交易费	-
合计	31, 319. 22

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	39, 671. 58
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	52. 00
指数使用费	-
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	69,476.36

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, 基金注册登记机构
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	16,678,207.15	100.00	39,806,947.75	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	-	-	2,530.74	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 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 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	15,199.12	100.00	2,523.91	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	36,276.28	100.00	15,140.99	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	13,357.46	16,523.37

其中：支付销售机构的客户维护费	47,640.82	50,957.12
-----------------	-----------	-----------

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

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，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。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
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	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	2,671.37	3,304.68

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

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，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、公休日等，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自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自有资金投资本基金。

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	4,320,815.25	7,864.33	4,504,517.08	15,630.54

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

于本报告期末，本基金持有 34,214,142.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 64.86%。（于上年度可比期间，本基金持有 47,014,142.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 71.72%。）

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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	1,200	6,708.00	6,708.00	

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。

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	4,320,815.25	-	-	-	-	-	4,320,815.25
结算备付金	9,950.24	-	-	-	-	-	9,950.24
存出保证金	4,848.21	-	-	-	-	-	4,848.21
交易性金融资产	-	-	-	-	-	74,204,580.04	74,204,580.04
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	375.25	375.25
应收申购款	-	-	-	-	-	58,029.93	58,029.93
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	4,335,613.70	-	-	-	-	74,262,985.22	78,598,598.92
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	106,039.35	106,039.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,934.22	1,934.22
应付托管费	-	-	-	-	-	386.82	386.82
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	-	-	-	-	-	2,523.91	2,523.91
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	69,747.46	69,747.46
负债	-	-	-	-	-	180,631.76	180,631.76

总计							
利率敏感 度缺口	4,335,613.70	-	-	-	-	74,082,353.46	78,417,967.16
上年 度末 2020 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	4,795,342.37	-	-	-	-	-	4,795,342.37
结算 备付 金	27,787.32	-	-	-	-	-	27,787.32
存出 保证 金	6,785.42	-	-	-	-	-	6,785.42
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	83,247,309.95	83,247,309.95
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 利息	-	-	-	-	-	480.69	480.69
应收 申购 款	-	-	-	-	-	54,947.02	54,947.02
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	755,898.91	755,898.91
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	4,829,915.11	-	-	-	-	84,058,636.57	88,888,551.68
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	944,858.74	944,858.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,624.85	2,624.85
应付托管费	-	-	-	-	-	524.96	524.96
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,717.06	2,717.06
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,934.05	1,934.05
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	142,681.54	142,681.54
负债总计	-	-	-	-	-	1,095,341.20	1,095,341.20
利率敏感度缺口	4,829,915.11	-	-	-	-	82,963,295.37	87,793,210.48

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的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	2,827,037.00	3.61	2,490,150.00	2.84
交易性金融资产—基金投资	71,377,543.04	91.02	80,757,159.95	91.99
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	74,204,580.04	94.63	83,247,309.95	94.82

注：本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股。其中投资于目标 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 指数上涨 5%	3,686,113.49	4,110,063.08
	深证 300 指数下跌 5%	-3,686,113.49	-4,110,063.08

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	2,827,037.00	3.60
	其中: 股票	2,827,037.00	3.60
2	基金投资	71,377,543.04	90.81
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	4,330,765.49	5.51
8	其他资产	63,253.39	0.08

9	合计	78,598,598.92	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	61,887.00	0.08
B	采矿业	12,818.00	0.02
C	制造业	2,060,548.00	2.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,784.00	0.01
E	建筑业	2,376.00	0.00
F	批发和零售业	17,124.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	38,130.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	147,367.00	0.19
J	金融业	203,482.00	0.26
K	房地产业	67,616.00	0.09
L	租赁和商务服务业	29,948.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	43,123.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	7,712.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,267.00	0.01
Q	卫生和社会工作	90,544.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	22,003.00	0.03
S	综合	7,308.00	0.01
	合计	2,827,037.00	3.61

7.2.2 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	300	160,440.00	0.20
2	000858	五粮液	400	119,156.00	0.15
3	000333	美的集团	1,100	78,507.00	0.10
4	002415	海康威视	900	58,050.00	0.07
5	000651	格力电器	1,100	57,310.00	0.07
6	300059	东方财富	1,700	55,743.00	0.07
7	002594	比亚迪	200	50,200.00	0.06

8	300760	迈瑞医疗	100	48,005.00	0.06
9	000568	泸州老窖	200	47,188.00	0.06
10	002475	立讯精密	1,000	46,000.00	0.06
11	300015	爱尔眼科	600	42,588.00	0.05
12	002304	洋河股份	200	41,440.00	0.05
13	000001	平安银行	1,800	40,716.00	0.05
14	000661	长春高新	100	38,700.00	0.05
15	300347	泰格医药	200	38,660.00	0.05
16	300122	智飞生物	200	37,346.00	0.05
17	000725	京东方 A	5,900	36,816.00	0.05
18	002714	牧原股份	600	36,492.00	0.05
19	000002	万科 A	1,500	35,715.00	0.05
20	300274	阳光电源	300	34,518.00	0.04
21	300014	亿纬锂能	300	31,179.00	0.04
22	300124	汇川技术	400	29,704.00	0.04
23	002371	北方华创	100	27,738.00	0.04
24	002142	宁波银行	700	27,279.00	0.03
25	002352	顺丰控股	400	27,080.00	0.03
26	002230	科大讯飞	400	27,032.00	0.03
27	002241	歌尔股份	600	25,644.00	0.03
28	000799	酒鬼酒	100	25,560.00	0.03
29	002460	赣锋锂业	200	24,218.00	0.03
30	002812	恩捷股份	100	23,410.00	0.03
31	000063	中兴通讯	700	23,261.00	0.03
32	002271	东方雨虹	400	22,128.00	0.03
33	300759	康龙化成	100	21,699.00	0.03
34	002709	天赐材料	200	21,316.00	0.03
35	002027	分众传媒	2,200	20,702.00	0.03
36	002410	广联达	300	20,460.00	0.03
37	000100	TCL 科技	2,600	19,890.00	0.03
38	002129	中环股份	500	19,300.00	0.02
39	300142	沃森生物	300	18,510.00	0.02
40	300450	先导智能	300	18,042.00	0.02
41	000338	潍柴动力	1,000	17,870.00	0.02
42	002311	海大集团	200	16,320.00	0.02
43	300498	温氏股份	1,100	15,807.00	0.02
44	002179	中航光电	200	15,804.00	0.02
45	300496	中科创达	100	15,706.00	0.02
46	002049	紫光国微	100	15,419.00	0.02
47	300601	康泰生物	100	14,900.00	0.02
48	300413	芒果超媒	200	13,720.00	0.02
49	000625	长安汽车	500	13,140.00	0.02
50	002074	国轩高科	300	13,068.00	0.02

51	300408	三环集团	300	12,726.00	0.02
52	300677	英科医疗	100	12,480.00	0.02
53	002841	视源股份	100	12,429.00	0.02
54	002493	荣盛石化	700	12,089.00	0.02
55	300676	华大基因	100	11,860.00	0.02
56	000786	北新建材	300	11,775.00	0.02
57	000538	云南白药	100	11,572.00	0.01
58	002920	德赛西威	100	11,008.00	0.01
59	002007	华兰生物	300	11,004.00	0.01
60	300558	贝达药业	100	10,824.00	0.01
61	002601	龙鳞佰利	300	10,374.00	0.01
62	300595	欧普康视	100	10,355.00	0.01
63	300316	晶盛机电	200	10,100.00	0.01
64	300037	新宙邦	100	10,010.00	0.01
65	300207	欣旺达	300	9,768.00	0.01
66	300285	国瓷材料	200	9,750.00	0.01
67	300003	乐普医疗	300	9,636.00	0.01
68	002050	三花智控	400	9,592.00	0.01
69	300012	华测检测	300	9,564.00	0.01
70	000895	双汇发展	300	9,540.00	0.01
71	002568	百润股份	100	9,479.00	0.01
72	002340	格林美	1,000	9,350.00	0.01
73	000157	中联重科	1,000	9,240.00	0.01
74	000963	华东医药	200	9,202.00	0.01
75	000776	广发证券	600	9,084.00	0.01
76	000166	申万宏源	1,900	8,892.00	0.01
77	300433	蓝思科技	300	8,823.00	0.01
78	300529	健帆生物	100	8,636.00	0.01
79	002001	新和成	300	8,604.00	0.01
80	300999	金龙鱼	100	8,496.00	0.01
81	002236	大华股份	400	8,440.00	0.01
82	000977	浪潮信息	300	8,439.00	0.01
83	300628	亿联网络	100	8,380.00	0.01
84	002008	大族激光	200	8,078.00	0.01
85	000768	中航西飞	300	7,884.00	0.01
86	002138	顺络电子	200	7,754.00	0.01
87	002185	华天科技	500	7,695.00	0.01
88	001979	招商蛇口	700	7,665.00	0.01
89	002223	鱼跃医疗	200	7,626.00	0.01
90	300699	光威复材	100	7,595.00	0.01
91	000876	新希望	500	7,335.00	0.01
92	000009	中国宝安	400	7,308.00	0.01
93	002202	金风科技	600	7,296.00	0.01

94	002555	三七互娱	300	7,206.00	0.01
95	002938	鹏鼎控股	200	7,176.00	0.01
96	002624	完美世界	300	7,173.00	0.01
97	000988	华工科技	300	7,056.00	0.01
98	002444	巨星科技	200	6,816.00	0.01
99	002024	苏宁易购	1,200	6,708.00	0.01
100	300146	汤臣倍健	200	6,580.00	0.01
101	000938	紫光股份	300	6,564.00	0.01
102	300253	卫宁健康	400	6,508.00	0.01
103	300482	万孚生物	100	6,469.00	0.01
104	002736	国信证券	600	6,450.00	0.01
105	002180	纳思达	200	6,440.00	0.01
106	300357	我武生物	100	6,412.00	0.01
107	002030	达安基因	300	6,372.00	0.01
108	000301	东方盛虹	300	6,270.00	0.01
109	002607	中公教育	300	6,267.00	0.01
110	002384	东山精密	300	6,252.00	0.01
111	002625	光启技术	300	6,243.00	0.01
112	300136	信维通信	200	6,176.00	0.01
113	300832	新产业	100	6,160.00	0.01
114	300001	特锐德	200	6,022.00	0.01
115	002422	科伦药业	300	5,985.00	0.01
116	000069	华侨城 A	800	5,952.00	0.01
117	002212	天融信	300	5,931.00	0.01
118	000739	普洛药业	200	5,880.00	0.01
118	002405	四维图新	400	5,880.00	0.01
120	000783	长江证券	800	5,856.00	0.01
121	000066	中国长城	400	5,840.00	0.01
122	002603	以岭药业	200	5,832.00	0.01
123	002439	启明星辰	200	5,802.00	0.01
124	000425	徐工机械	900	5,733.00	0.01
125	002797	第一创业	800	5,712.00	0.01
126	000547	航天发展	300	5,661.00	0.01
127	002690	美亚光电	100	5,576.00	0.01
128	002414	高德红外	200	5,516.00	0.01
129	002600	领益智造	600	5,514.00	0.01
130	002511	中顺洁柔	200	5,510.00	0.01
131	002044	美年健康	600	5,466.00	0.01
132	002252	上海莱士	700	5,243.00	0.01
133	002080	中材科技	200	5,234.00	0.01
134	300144	宋城演艺	300	5,040.00	0.01
135	002013	中航机电	500	5,035.00	0.01
136	002373	千方科技	300	5,010.00	0.01

137	000513	丽珠集团	100	5,002.00	0.01
138	002459	晶澳科技	100	4,900.00	0.01
139	002572	索菲亚	200	4,840.00	0.01
140	000998	隆平高科	300	4,812.00	0.01
141	000960	锡业股份	300	4,809.00	0.01
142	002156	通富微电	200	4,808.00	0.01
143	000728	国元证券	600	4,782.00	0.01
144	000703	恒逸石化	400	4,780.00	0.01
145	002299	圣农发展	200	4,776.00	0.01
146	000807	云铝股份	400	4,760.00	0.01
147	002508	老板电器	100	4,650.00	0.01
148	000623	吉林敖东	300	4,647.00	0.01
149	002463	沪电股份	300	4,641.00	0.01
150	002602	世纪华通	700	4,494.00	0.01
151	002626	金达威	100	4,470.00	0.01
151	300009	安科生物	300	4,470.00	0.01
151	002353	杰瑞股份	100	4,470.00	0.01
154	002456	欧菲光	500	4,440.00	0.01
155	002075	沙钢股份	400	4,364.00	0.01
156	300383	光环新网	300	4,317.00	0.01
157	002557	洽洽食品	100	4,310.00	0.01
158	002151	北斗星通	100	4,307.00	0.01
159	002064	华峰化学	300	4,260.00	0.01
160	000050	深天马 A	300	4,254.00	0.01
161	000860	顺鑫农业	100	4,218.00	0.01
162	300463	迈克生物	100	4,209.00	0.01
163	002382	蓝帆医疗	200	4,170.00	0.01
164	000708	中信特钢	200	4,168.00	0.01
165	000581	威孚高科	200	4,166.00	0.01
165	000738	航发控制	200	4,166.00	0.01
167	000983	山西焦煤	500	4,155.00	0.01
168	002372	伟星新材	200	4,134.00	0.01
169	300088	长信科技	500	4,130.00	0.01
170	000630	铜陵有色	1,500	4,080.00	0.01
170	002385	大北农	600	4,080.00	0.01
172	002120	韵达股份	300	4,059.00	0.01
173	000656	金科股份	700	4,053.00	0.01
174	002078	太阳纸业	300	4,005.00	0.01
175	000932	华菱钢铁	600	3,960.00	0.01
176	002152	广电运通	300	3,909.00	0.00
177	002127	南极电商	400	3,908.00	0.00
178	002925	盈趣科技	100	3,891.00	0.00
179	300308	中际旭创	100	3,852.00	0.00

180	300271	华宇软件	200	3,850.00	0.00
181	000878	云南铜业	300	3,849.00	0.00
182	300244	迪安诊断	100	3,830.00	0.00
183	000021	深科技	200	3,828.00	0.00
184	000975	银泰黄金	400	3,804.00	0.00
185	002465	海格通信	400	3,784.00	0.00
186	002507	涪陵榨菜	100	3,766.00	0.00
187	000825	太钢不锈	500	3,745.00	0.00
188	003816	中国广核	1,400	3,738.00	0.00
189	000401	冀东水泥	300	3,705.00	0.00
190	300070	碧水源	500	3,655.00	0.00
191	000423	东阿阿胶	100	3,591.00	0.00
192	002157	正邦科技	300	3,585.00	0.00
193	002430	杭氧股份	100	3,459.00	0.00
194	002019	亿帆医药	200	3,450.00	0.00
195	000750	国海证券	800	3,392.00	0.00
196	002500	山西证券	500	3,355.00	0.00
197	002939	长城证券	300	3,339.00	0.00
198	000997	新大陆	200	3,318.00	0.00
199	002673	西部证券	400	3,300.00	0.00
200	002294	信立泰	100	3,290.00	0.00
201	300418	昆仑万维	200	3,276.00	0.00
202	002242	九阳股份	100	3,249.00	0.00
203	300251	光线传媒	300	3,243.00	0.00
204	300024	机器人	300	3,201.00	0.00
205	002065	东华软件	400	3,172.00	0.00
206	300748	金力永磁	100	3,163.00	0.00
207	300296	利亚德	400	3,128.00	0.00
208	002131	利欧股份	1,300	3,042.00	0.00
209	300058	蓝色光标	500	3,025.00	0.00
210	000723	美锦能源	400	3,024.00	0.00
211	000617	中油资本	500	3,010.00	0.00
212	002831	裕同科技	100	2,969.00	0.00
213	002966	苏州银行	400	2,940.00	0.00
214	300017	网宿科技	500	2,925.00	0.00
215	002926	华西证券	300	2,889.00	0.00
216	300773	拉卡拉	100	2,823.00	0.00
217	002506	协鑫集成	800	2,784.00	0.00
218	002683	宏大爆破	100	2,777.00	0.00
219	000027	深圳能源	300	2,751.00	0.00
220	300212	易华录	100	2,691.00	0.00
221	002745	木林森	200	2,680.00	0.00
222	000999	华润三九	100	2,675.00	0.00

223	002595	豪迈科技	100	2,670.00	0.00
224	002558	巨人网络	200	2,660.00	0.00
225	002705	新宝股份	100	2,625.00	0.00
226	002056	横店东磁	200	2,600.00	0.00
226	000671	阳光城	500	2,600.00	0.00
228	002958	青农商行	600	2,568.00	0.00
229	000990	诚志股份	200	2,546.00	0.00
230	000686	东北证券	300	2,535.00	0.00
231	000987	越秀金控	200	2,532.00	0.00
232	002281	光迅科技	100	2,460.00	0.00
233	002563	森马服饰	200	2,390.00	0.00
234	002081	金螳螂	300	2,376.00	0.00
235	000961	中南建设	400	2,368.00	0.00
236	002153	石基信息	100	2,351.00	0.00
237	000089	深圳机场	300	2,331.00	0.00
238	002773	康弘药业	100	2,313.00	0.00
238	002010	传化智联	300	2,313.00	0.00
240	000883	湖北能源	500	2,295.00	0.00
241	002670	国盛金控	200	2,278.00	0.00
242	002146	荣盛发展	400	2,256.00	0.00
243	000709	河钢股份	900	2,214.00	0.00
244	002936	郑州银行	600	2,202.00	0.00
245	000540	中天金融	800	2,184.00	0.00
246	000729	燕京啤酒	300	2,172.00	0.00
247	000800	一汽解放	200	2,164.00	0.00
248	002128	露天煤业	200	2,082.00	0.00
249	000967	盈峰环境	300	2,061.00	0.00
250	000402	金融街	300	2,025.00	0.00
251	002110	三钢闽光	300	2,022.00	0.00
252	002266	浙富控股	400	1,996.00	0.00
253	002867	周大生	100	1,977.00	0.00
254	000629	攀钢钒钛	800	1,832.00	0.00
255	000930	中粮科技	200	1,802.00	0.00
256	000898	鞍钢股份	400	1,780.00	0.00
257	300188	美亚柏科	100	1,740.00	0.00
258	001914	招商积余	100	1,718.00	0.00
259	001872	招商港口	100	1,692.00	0.00
260	002216	三全食品	100	1,647.00	0.00
261	002399	海普瑞	100	1,593.00	0.00
261	000559	万向钱潮	300	1,593.00	0.00
263	002468	申通快递	200	1,524.00	0.00
264	000627	天茂集团	400	1,448.00	0.00
265	001965	招商公路	200	1,444.00	0.00

266	002945	华林证券	100	1,382.00	0.00
267	000785	居然之家	200	1,214.00	0.00
268	000959	首钢股份	200	1,124.00	0.00
269	002461	珠江啤酒	100	1,094.00	0.00
270	000031	大悦城	300	1,080.00	0.00
271	000046	泛海控股	400	920.00	0.00
272	000958	东方能源	200	878.00	0.00
273	002532	天山铝业	100	839.00	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	000333	美的集团	166,217.00	0.19
2	002415	海康威视	160,173.00	0.18
3	300059	东方财富	157,891.00	0.18
4	000001	平安银行	145,060.00	0.17
5	000858	五粮液	140,937.00	0.16
6	000002	万科A	130,733.80	0.15
7	000725	京东方A	128,197.00	0.15
8	002475	立讯精密	123,645.00	0.14
9	300750	宁德时代	109,046.00	0.12
10	002714	牧原股份	105,237.00	0.12
11	000651	格力电器	104,377.00	0.12
12	002142	宁波银行	92,363.00	0.11
13	002352	顺丰控股	89,913.00	0.10
14	002027	分众传媒	79,490.00	0.09
15	000568	泸州老窖	45,860.00	0.05
16	300122	智飞生物	42,352.00	0.05
17	002304	洋河股份	37,478.00	0.04
18	300015	爱尔眼科	34,665.00	0.04
19	000100	TCL 科技	30,565.00	0.03
20	300347	泰格医药	29,200.00	0.03

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	926,684.00	1.06
2	000333	美的集团	869,904.00	0.99
3	300750	宁德时代	683,872.00	0.78
4	000651	格力电器	470,132.00	0.54
5	300059	东方财富	462,262.00	0.53
6	002415	海康威视	434,349.00	0.49
7	002475	立讯精密	424,765.00	0.48
8	000002	万 科 A	381,312.00	0.43
9	000001	平安银行	377,063.00	0.43
10	000725	京东方 A	355,283.00	0.40
11	002714	牧原股份	313,252.00	0.36
12	002352	顺丰控股	301,833.00	0.34
13	002142	宁波银行	257,520.00	0.29
14	000568	泸州老窖	255,503.00	0.29
15	002027	分众传媒	229,553.00	0.26
16	002304	洋河股份	218,396.00	0.25
17	002594	比亚迪	210,625.00	0.24
18	300015	爱尔眼科	192,412.00	0.22
19	000661	长春高新	181,131.00	0.21
20	300760	迈瑞医疗	176,609.00	0.20

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	2,039,131.80
卖出股票收入（成交）总额	14,639,075.35

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	159912	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金	交易型开放式	34,214,142.00	71,377,543.04	91.02	是

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

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。

7.13.2

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。

7.13.3 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	4,848.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	375.25
5	应收申购款	58,029.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,253.39

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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（%）
4,004	9,300.85	528,984.82	1.42	36,711,627.41	98.58

8.2 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	599.67	0.00

8.3 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 28 日） 基金份额总额	336,005,348.19
本报告期期初基金份额总额	43,625,181.44
本报告期基金总申购份额	13,691,382.74
减：本报告期基金总赎回份额	20,075,951.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	37,240,612.23

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	3	16,678,207.15	100.00	15,199.12	100.00	

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	-	-	-	-	-	-	-	-

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基金开展线上直销系统费率优惠活动的提示性公告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021年01月09日
2	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
3	汇添富基金管理股份有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	公司网站	2021年02月08日
4	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
5	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
6	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
7	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

8	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

注：无。

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、中国证监会批准汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
- 2、《汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3、《汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接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