

深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 08 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 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）	78,448,991.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 11 月 24 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，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	上海市黄浦区外马路728号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200010	100140
法定代表人	李文	廖林

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	上海市黄浦区外马路728号 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(2024年01月01日 - 2024年06月30日)
本期已实现收益	-580,418.93
本期利润	-4,474,060.33
加权平均基金份额本期利润	-0.0592
本期加权平均净值利润率	-4.75%
本期基金份额净值增长率	-5.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	16,376,948.36
期末可供分配基金份额利润	0.2088
期末基金资产净值	94,825,939.36
期末基金份额净值	1.2088
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	20.88%

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

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	-4.73%	0.80%	-5.12%	0.80%	0.39%	0.00%
过去三个月	-4.40%	1.07%	-5.44%	1.08%	1.04%	-0.01%
过去六个月	-5.06%	1.32%	-5.90%	1.32%	0.84%	0.00%
过去一年	-18.58%	1.15%	-19.43%	1.16%	0.85%	-0.01%
过去三年	-42.06%	1.22%	-43.49%	1.23%	1.43%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	20.88%	1.50%	10.95%	1.53%	9.93%	-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。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 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

汇添富基金成立于2005年2月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国及新加坡设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司、汇添富资产管理（新加坡）有限公司、汇添富投资管理有限公司。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、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、

国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2024 上半年，汇添富基金新成立 22 只公开募集证券投资基金，包括 12 只股票型基金、9 只债券型基金、1 只混合型基金。截至 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 336 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		
晏阳	本基金的基金经理	2023 年 05 月 22 日	-	8	国籍：中国。学历：哥伦比亚大学统计学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2016 年 9 月至 2021 年 8 月任中证指数有限公司研究员、高级研究员。2021 年 9 月加入汇添富基金管理股份有限公司，担任指数与量化投资部基金经理。2022 年 7 月 13 日至今任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至今任汇添富中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经

					<p>理。2022 年 12 月 27 日至今任汇添富北证 50 成份指数型证券投资基金的基金经理。2023 年 1 月 16 日至 2024 年 4 月 8 日任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月 14 日至今任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 4 月 13 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。</p> <p>2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日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。2023 年 5 月 22 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。2023 年 5 月 22 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。2023 年 5 月 24 日至今任汇添</p>
--	--	--	--	--	--

				<p>富中证国新央企 股东回报交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2023 年 6 月 20 日至今任汇 添富中证 800 价 值交易型开放式 指数证券投资基金 的基金经理。 2023 年 7 月 11 日至今任汇添富 华证专精特新 100 指数型发起 式证券投资基金 的基金经理。 2023 年 9 月 26 日至今任汇添富 中证红利交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2023 年 11 月 21 日至今任汇 添富中证 800 价 值交易型开放式 指数证券投资基金 发起式联接基金 的基金经理。 2023 年 11 月 28 日至今任汇添富 中证细分有色金 属产业主题交易 型开放式指数证 券投资基金发起 式联接基金的基 金经理。2023 年 12 月 5 日至今任 汇添富中证电信 主题交易型开放 式指数证券投资 基金的基金经 理。2024 年 2 月 2 日至今任汇添 富中证国新央企</p>
--	--	--	--	---

					<p>股东回报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>2024 年 4 月 24 日至今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2024 年 5 月 31 日至今任汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2024 年 6 月 12 日至今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注: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。

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。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

对不同投资组合进行同向交易价差分析，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平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 6 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，国民经济总体运行平稳，延续恢复态势。初步核算，上半年国内生产总值约 61.7 万亿元，同比增长 5.0%，其中一季度同比增长 5.3%，二季度增长 4.7%。生产端，上半年全国规模以上工业增加值同比增长 6.0%，装备制造业支撑作用明显；投资端，上半

年全国固定资产投资（不含农户）同比增长 3.9%，其中基础设施投资增长 5.4%，制造业投资增长 9.5%，房地产开发投资下降 10.1%；消费端，上半年社会消费品零售总额同比增长 3.7%，服务消费增势较好。总体来看，上半年经济稳中向好，转型升级稳步推进，但国内有效需求依然有待提振，经济基础仍需巩固。

资本市场方面，上半年 A 股在震荡中前行。分阶段看，开年后市场整体弱势，指数加速探底；2 月以来迎来强势反弹，其后逐步企稳；5 月下旬以来又有所回调。分行业来看，上半年银行、煤炭和公用事业等板块表现较好，计算机、商贸零售和社会服务等板块表现靠后。风格方面，大盘优于小盘，价值优于成长，红利延续强势。

深证 300 指数囊括深交所市值较大的 300 只股票，表征深市整体表现。报告期内，本基金按照被动投资的原则，采用完全复制法，实现了对标的指数的美好跟踪。

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-5.06%。同期业绩比较基准收益率为-5.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着政策效应逐步显现，国内经济有望继续巩固回升。

财政政策方面，超长期特别国债陆续发行落地，将逐步形成实物工作量；货币政策方面，稳增长方向持续发力，注重做好逆周期调节，三季度或将再度开启降准降息窗口；房地产政策方面，从中央到地方政策持续调整优化，房价下行有望迎来自然收敛，推动市场企稳。

资本市场方面，从整体上看，当前各大指数估值水平相对较低，市场整体投资性价比较高；从风格上看，在外部环境不确定性依然较强而国内经济仍处弱复苏的背景下，价值、红利风格或将继续占优；从行业主题上看，顺应时代趋势的科技创新、企业出海等值得关注。深证 300 指数涵盖众多优质成长型企业，具有良好的投资价值。

作为被动投资的指数型基金，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法严格控制跟踪误差。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不

存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，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。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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本基金 2024 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：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	372,944.64	314,372.93
结算备付金		5,425.08	-
存出保证金		235.29	240.72
交易性金融资产	6.4.7.2	94,593,980.87	90,253,222.22
其中：股票投资		94,593,980.87	90,253,222.22
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		94,972,585.88	90,567,835.87
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		39,188.01	37,684.17
应付托管费		7,837.61	7,536.85
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.7	99,620.90	190,500.00
负债合计		146,646.52	235,721.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	78,448,991.00	70,948,991.00
未分配利润	6.4.7.9	16,376,948.36	19,383,123.85
净资产合计		94,825,939.36	90,332,114.85
负债和净资产总计		94,972,585.88	90,567,835.87

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2088 元，基金份额总额 78,448,991.00 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：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-4,063,396.94	133,352.19
1. 利息收入		602.58	1,289.65
其中：存款利息收入	6.4.7.10	602.58	1,289.65
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-171,355.20	159,950.32
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-1,434,098.22	-723,048.76
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
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	1,262,743.02	882,999.08
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-3,893,641.40	-27,887.78
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	997.08	-
减：二、营业总支出		410,663.39	397,892.06

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	233,876.40	223,225.65
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	46,775.31	44,645.07
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.21	130,011.68	130,021.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,474,060.33	-264,539.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,474,060.33	-264,539.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,474,060.33	-264,539.87

6.3 净资产变动表

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：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	70,948,991.00	19,383,123.85	90,332,114.85
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	70,948,991.00	19,383,123.85	90,332,114.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,500,000.00	-3,006,175.49	4,493,824.51
（一）、综合收益总额	-	-4,474,060.33	-4,474,060.33
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	7,500,000.00	1,467,884.84	8,967,884.84
其中：1. 基金申购款	7,500,000.00	1,467,884.84	8,967,884.84

2. 基金赎回款	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	78,448,991.00	16,376,948.36	94,825,939.36
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	58,448,991.00	28,595,713.96	87,044,704.96
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	58,448,991.00	28,595,713.96	87,044,704.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-264,539.87	-264,539.87
(一)、综合收益总额	-	-264,539.87	-264,539.87
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	58,448,991.00	28,331,174.09	86,780,165.09

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

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》准予注册，由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）向社会公开募集。基金合同于 2011 年 9 月 16 日生效。首次设立基金募集规模为 521,548,991.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2011）验字第 60466941_B08 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，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。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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。本基金的业绩比较基准为：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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员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 3 号《半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〉》以及中国证监会和中国证券投资

基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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

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‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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。

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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法》、《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。

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。

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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	372,944.64
等于：本金	372,913.10
加：应计利息	31.54
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	372,944.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	109,581,500.95	-	94,593,980.87	-14,987,520.08
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	109,581,500.95	-	94,593,980.87	-14,987,520.08

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

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 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	-
应付交易费用	4,699.22
其中：交易所市场	4,699.22
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	20,140.12
应付信息披露费	39,781.56
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	-
应付或有管理费	-
其他	-
合计	99,620.90

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,948,991.00	70,948,991.00
本期申购	7,500,000.00	7,500,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
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	78,448,991.00	78,448,991.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 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	62,816,865.17	-43,433,741.32	19,383,123.85

加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	62,816,865.17	-43,433,741.32	19,383,123.85
本期利润	-580,418.93	-3,893,641.40	-4,474,060.33
本期基金份额交易产生的变动数	6,617,352.85	-5,149,468.01	1,467,884.84
其中：基金申购款	6,617,352.85	-5,149,468.01	1,467,884.84
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,853,799.09	-52,476,850.73	16,376,948.36

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	561.94
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	39.81
其他	0.83
合计	602.58

注：“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	3,178,138.40
减：卖出股票成本总额	4,605,000.71
减：交易费用	7,235.91
买卖股票差价收入	-1,434,098.22

6.4.7.11.2 股票投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

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——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 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其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,262,743.02
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	1,262,743.02

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1. 交易性金融资产	-3,893,641.40
——股票投资	-3,893,641.40
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动	-

产生的预估增值税	
合计	-3,893,641.40

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	997.08
其他	-
合计	997.08

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	20,140.12
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	90.00
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	-
或有管理费	-
其他	-
合计	130,011.68

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

根据《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《基金管理公司子公司管理规定》等法律法规的有关规定,经中国证券监督管理委员会同意,汇添富基金管理股份有限公司(以下简称“本公司”)已受让汇添富资本管理有限公司持有的汇添富投资管理有限公司(以下简称“汇添富投资”)全部股权。汇添富投资已由本公司的“全资子公司的全资子公司”变更为“全资子公司”。

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
东方证券股份有限公司(“东方证券”)	基金管理人的股东
汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	7,058,112.40	100.00	6,183,954.85	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

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交易。

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均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 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	5,194.07	100.00	4,699.22	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	4,460.57	100.00	4,058.80	100.00

注：上述佣金的计算方式按相关协议约定的佣金率计算。上述佣金与应支付非关联方交易佣金的计算方式、佣金计算比率不存在差异，具有公允性。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（被动股票型基金不适用）。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	233,876.40	223,225.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	233,876.40	223,225.65

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。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

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
	2024年01月01日至2024年06月30日	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	46,775.31	44,645.07

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比

		例 (%)		例 (%)
汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	44,847,842.00	57.17	39,917,842.00	56.26

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	372,944.64	561.94	459,244.07	1,247.33

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（2024 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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2024 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 2024 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 2024 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。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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							
货币资金	372,944.64	-	-	-	-	-	372,944.64
结算备付金	5,425.08	-	-	-	-	-	5,425.08
存出保证金	235.29	-	-	-	-	-	235.29
交易性金融资产	-	-	-	-	-	94,593,980.87	94,593,980.87
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	378,605.01	-	-	-	-	94,593,980.87	94,972,585.88
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-

债							
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	39,188.01	39,188.01
应付托管费	-	-	-	-	-	7,837.61	7,837.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	99,620.90	99,620.90
负债总计	-	-	-	-	-	146,646.52	146,646.52
利率敏感	378,605.01	-	-	-	-	94,447,334.35	94,825,939.36

度缺 口							
上年 度末 2023 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							
货币 资金	314,372.93	-	-	-	-	-	314,372.93
结算 备付 金	-	-	-	-	-	-	-
存出 保证 金	240.72	-	-	-	-	-	240.72
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	90,253,222.22	90,253,222.22
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	314,613.65	-	-	-	-	90,253,222.22	90,567,835.87
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	37,684.17	37,684.17
应付托管费	-	-	-	-	-	7,536.85	7,536.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得	-	-	-	-	-	-	-

税负债							
其他负债	-	-	-	-	-	190,500.00	190,500.00
负债总计	-	-	-	-	-	235,721.02	235,721.02
利率敏感度缺口	314,613.65	-	-	-	-	90,017,501.20	90,332,114.85

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券(不含可转换债券及可交换债券)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

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 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	94,593,980.87	99.76	90,253,222.22	99.91
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	94,593,980.87	99.76	90,253,222.22	99.91

	7		2
--	---	--	---

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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	深证 300 指数上涨 5%	4,725,300.30	4,495,568.58
	深证 300 指数下跌 5%	-4,725,300.30	-4,495,568.58

注:本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时,将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日
第一层次	94,593,980.87
第二层次	-
第三层次	-

合计	94,593,980.87
----	---------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“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”章节中所列示情况外，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	94,593,980.87	99.60
	其中：股票	94,593,980.87	99.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	378,369.72	0.40
8	其他各项资产	235.29	0.00
9	合计	94,972,585.88	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	2,703,492.14	2.85
B	采矿业	1,096,782.31	1.16
C	制造业	73,117,480.29	77.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,188,126.33	1.25
E	建筑业	73,402.00	0.08
F	批发和零售业	243,977.13	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	1,320,311.84	1.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,034,081.57	4.25
J	金融业	6,824,892.14	7.20
K	房地产业	1,016,887.47	1.07
L	租赁和商务服务业	767,390.28	0.81
M	科学研究和技术服务业	808,386.00	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	172,346.99	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	84,150.00	0.09
Q	卫生和社会工作	683,418.64	0.72
R	文化、体育和娱乐业	458,855.74	0.48
S	综合	-	-
	合计	94,593,980.87	99.76

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境内股票。

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	29,580	5,325,287.40	5.62
2	000333	美的集团	56,084	3,617,418.00	3.81

3	000858	五 粮 液	21,068	2,697,546.72	2.84
4	002594	比亚迪	9,793	2,450,698.25	2.58
5	002475	立讯精密	53,188	2,090,820.28	2.20
6	000651	格力电器	51,348	2,013,868.56	2.12
7	300760	迈瑞医疗	6,100	1,774,551.00	1.87
8	300059	东方财富	144,484	1,525,751.04	1.61
9	000725	京东方 A	367,108	1,501,471.72	1.58
10	300308	中际旭创	10,052	1,385,969.76	1.46
11	002415	海康威视	43,611	1,348,016.01	1.42
12	002714	牧原股份	28,789	1,255,200.40	1.32
13	300498	温氏股份	62,597	1,240,672.54	1.31
14	000568	泸州老窖	8,622	1,237,170.78	1.30
15	300124	汇川技术	22,252	1,141,527.60	1.20
16	000063	中兴通讯	36,883	1,031,617.51	1.09
17	002371	北方华创	3,200	1,023,648.00	1.08
18	300274	阳光电源	16,460	1,021,013.80	1.08
19	000001	平安银行	97,921	993,898.15	1.05
20	000338	潍柴动力	58,824	955,301.76	1.01
21	002352	顺丰控股	26,400	942,216.00	0.99
22	002230	科大讯飞	21,485	922,780.75	0.97
23	000100	TCL 科技	210,077	907,532.64	0.96
24	002142	宁波银行	39,570	872,914.20	0.92
25	000792	盐湖股份	44,800	781,760.00	0.82
26	300502	新易盛	7,200	759,960.00	0.80
27	002027	分众传媒	116,888	708,341.28	0.75
28	000625	长安汽车	49,675	667,135.25	0.70
29	000425	徐工机械	88,498	632,760.70	0.67
30	300014	亿纬锂能	14,618	583,550.56	0.62
31	002463	沪电股份	15,530	566,845.00	0.60
32	002304	洋河股份	6,883	555,733.42	0.59
33	002241	歌尔股份	28,190	549,986.90	0.58
34	300015	爱尔眼科	49,890	514,864.80	0.54
35	000002	万 科 A	70,998	492,016.14	0.52
36	002179	中航光电	12,866	489,551.30	0.52
37	002050	三花智控	23,956	457,080.48	0.48
38	000538	云南白药	8,901	455,286.15	0.48
39	000938	紫光股份	20,058	448,296.30	0.47
40	000166	申万宏源	102,306	440,938.86	0.46
41	000977	浪潮信息	12,011	436,840.07	0.46
42	002028	思源电气	6,500	434,850.00	0.46
43	300408	三环集团	14,600	426,174.00	0.45
44	002311	海大集团	8,994	423,167.70	0.45
45	002252	上海莱士	53,613	419,253.66	0.44

46	300433	蓝思科技	22,419	409,146.75	0.43
47	002422	科伦药业	13,416	406,907.28	0.43
48	000157	中联重科	51,843	398,154.24	0.42
49	000776	广发证券	32,692	397,861.64	0.42
50	002049	紫光国微	7,485	393,711.00	0.42
51	003816	中国广核	80,700	373,641.00	0.39
52	300122	智飞生物	13,100	367,193.00	0.39
53	002460	赣锋锂业	12,720	364,428.00	0.38
54	000933	神火股份	17,900	362,117.00	0.38
55	000768	中航西飞	15,020	360,930.60	0.38
56	002648	卫星化学	20,000	359,600.00	0.38
57	000596	古井贡酒	1,700	358,819.00	0.38
58	002466	天齐锂业	11,900	355,929.00	0.38
59	002340	格林美	55,803	355,465.11	0.37
60	001979	招商蛇口	39,671	348,708.09	0.37
61	002001	新和成	17,824	342,220.80	0.36
62	002236	大华股份	21,745	336,177.70	0.35
63	002601	龙佰集团	18,000	334,260.00	0.35
64	002493	荣盛石化	34,450	332,787.00	0.35
65	000423	东阿阿胶	5,300	331,780.00	0.35
66	000807	云铝股份	24,100	325,591.00	0.34
67	000661	长春高新	3,490	320,277.30	0.34
68	000786	北新建材	10,544	312,735.04	0.33
69	000975	银泰黄金	19,100	311,139.00	0.33
70	300394	天孚通信	3,500	309,470.00	0.33
71	300418	昆仑万维	9,500	306,280.00	0.32
72	002384	东山精密	14,750	305,325.00	0.32
73	300782	卓胜微	3,878	301,475.72	0.32
74	000983	山西焦煤	29,001	299,000.31	0.32
75	300347	泰格医药	6,150	298,890.00	0.32
76	300661	圣邦股份	3,548	293,703.44	0.31
77	002129	TCL 中环	33,911	293,330.15	0.31
78	000895	双汇发展	12,318	292,798.86	0.31
79	000988	华工科技	9,746	291,697.78	0.31
80	002938	鹏鼎控股	7,300	290,248.00	0.31
81	000630	铜陵有色	80,235	289,648.35	0.31
82	002180	纳思达	10,700	282,694.00	0.30
83	300896	爱美客	1,640	282,244.00	0.30
84	002271	东方雨虹	22,770	280,981.80	0.30
85	002156	通富微电	12,500	279,875.00	0.30
86	002625	光启技术	16,000	277,600.00	0.29
87	002736	国信证券	31,675	275,255.75	0.29
88	002966	苏州银行	35,170	263,775.00	0.28

89	002223	鱼跃医疗	6,926	260,417.60	0.27
90	000400	许继电气	7,400	254,634.00	0.27
91	002078	太阳纸业	18,200	253,890.00	0.27
92	002920	德赛西威	2,900	252,561.00	0.27
93	300832	新产业	3,700	249,528.00	0.26
94	000963	华东医药	8,773	243,977.13	0.26
95	300207	欣旺达	16,000	242,720.00	0.26
96	002185	华天科技	29,777	242,682.55	0.26
97	002353	杰瑞股份	6,911	242,437.88	0.26
98	300033	同花顺	2,332	241,828.40	0.26
99	002709	天赐材料	13,760	241,625.60	0.25
100	002128	电投能源	11,400	240,540.00	0.25
101	002532	天山铝业	29,600	240,056.00	0.25
102	002074	国轩高科	12,487	239,126.05	0.25
103	000999	华润三九	5,576	237,426.08	0.25
104	002916	深南电路	2,240	236,924.80	0.25
105	002459	晶澳科技	20,824	233,228.80	0.25
106	002600	领益智造	32,600	232,112.00	0.24
107	002602	世纪华通	67,276	230,756.68	0.24
108	300573	兴齐眼药	1,400	229,600.00	0.24
109	301236	软通动力	6,500	228,865.00	0.24
110	000301	东方盛虹	28,700	228,739.00	0.24
111	000876	新希望	24,606	224,898.84	0.24
112	002797	第一创业	44,020	224,061.80	0.24
113	002465	海格通信	21,530	223,050.80	0.24
114	002555	三七互娱	17,000	221,850.00	0.23
115	002138	顺络电子	8,000	219,680.00	0.23
116	300142	沃森生物	18,800	213,944.00	0.23
117	300003	乐普医疗	14,206	210,817.04	0.22
118	000408	藏格矿业	8,700	209,409.00	0.22
119	002281	光迅科技	5,600	209,272.00	0.22
120	001965	招商公路	17,600	208,736.00	0.22
121	300751	迈为股份	1,744	208,373.12	0.22
122	000831	中国稀土	8,100	205,335.00	0.22
123	300316	晶盛机电	7,100	203,983.00	0.22
124	000683	远兴能源	29,500	203,845.00	0.21
125	002202	金风科技	30,276	203,454.72	0.21
126	000066	中国长城	23,136	202,440.00	0.21
127	000878	云南铜业	16,223	202,138.58	0.21
128	002409	雅克科技	3,200	201,312.00	0.21
129	002444	巨星科技	8,100	200,070.00	0.21
130	000932	华菱钢铁	45,080	199,704.40	0.21
131	002008	大族激光	9,540	198,432.00	0.21

132	300759	康龙化成	10,650	197,877.00	0.21
133	300628	亿联网络	5,360	197,087.20	0.21
134	002517	恺英网络	20,600	196,730.00	0.21
135	002738	中矿资源	7,320	196,176.00	0.21
136	000733	振华科技	4,600	191,038.00	0.20
137	300450	先导智能	11,306	188,018.78	0.20
138	000728	国元证券	30,848	186,938.88	0.20
139	002007	华兰生物	11,777	185,958.83	0.20
140	002595	豪迈科技	4,800	183,216.00	0.19
141	300496	中科创达	4,000	182,360.00	0.19
142	300054	鼎龙股份	8,000	181,440.00	0.19
143	002812	恩捷股份	5,730	181,354.50	0.19
144	002436	兴森科技	17,300	178,536.00	0.19
145	300999	金龙鱼	6,500	177,775.00	0.19
146	300223	北京君正	3,200	177,408.00	0.19
147	300474	景嘉微	2,800	177,044.00	0.19
148	002673	西部证券	28,402	175,808.38	0.19
149	300866	安克创新	2,440	173,752.40	0.18
150	000960	锡业股份	11,125	172,326.25	0.18
151	002739	万达电影	14,200	171,678.00	0.18
152	000783	长江证券	35,199	170,011.17	0.18
153	000021	深科技	11,100	167,832.00	0.18
154	300001	特锐德	8,300	166,996.00	0.18
155	002821	凯莱英	2,520	165,816.00	0.17
156	002472	双环传动	7,500	165,150.00	0.17
157	300012	华测检测	16,200	162,972.00	0.17
158	300285	国瓷材料	9,100	162,435.00	0.17
159	000703	恒逸石化	22,910	162,431.90	0.17
160	301269	华大九天	2,100	161,805.00	0.17
161	300037	新宙邦	5,640	161,078.40	0.17
162	000617	中油资本	28,900	159,528.00	0.17
163	000738	航发控制	7,948	159,516.36	0.17
164	000009	中国宝安	18,432	158,515.20	0.17
165	000513	丽珠集团	4,243	157,882.03	0.17
166	300073	当升科技	4,600	157,826.00	0.17
167	002405	四维图新	25,191	156,688.02	0.17
168	300724	捷佳伟创	2,900	156,629.00	0.17
169	002152	广电运通	14,860	155,435.60	0.16
170	300146	汤臣倍健	11,388	154,307.40	0.16
171	002850	科达利	2,000	152,760.00	0.16
172	000723	美锦能源	31,800	151,368.00	0.16
173	002410	广联达	15,794	151,306.52	0.16
174	300395	菲利华	4,900	150,675.00	0.16

175	300919	中伟股份	4,860	150,611.40	0.16
176	300413	芒果超媒	7,160	149,644.00	0.16
177	300699	光威复材	6,020	149,476.60	0.16
178	002984	森麒麟	6,200	149,358.00	0.16
179	300114	中航电测	3,300	149,325.00	0.16
180	002407	多氟多	12,200	149,206.00	0.16
181	002294	信立泰	5,602	149,181.26	0.16
182	002025	航天电器	3,200	148,416.00	0.16
183	300144	宋城演艺	18,476	148,362.28	0.16
184	000921	海信家电	4,600	148,304.00	0.16
185	002262	恩华药业	6,200	147,188.00	0.16
186	301358	湖南裕能	4,600	144,716.00	0.15
187	000591	太阳能	30,700	144,597.00	0.15
188	002176	江特电机	17,600	143,440.00	0.15
189	002385	大北农	36,787	141,629.95	0.15
190	300454	深信服	2,800	141,484.00	0.15
191	002064	华峰化学	19,700	141,249.00	0.15
192	000519	中兵红箭	9,600	140,832.00	0.15
193	000750	国海证券	47,949	139,531.59	0.15
194	002603	以岭药业	9,080	139,196.40	0.15
195	300529	健帆生物	5,110	139,043.10	0.15
196	000623	吉林敖东	10,361	138,837.40	0.15
197	300251	光线传媒	16,506	138,815.46	0.15
198	002439	启明星辰	8,020	138,425.20	0.15
199	002558	巨人网络	14,600	137,824.00	0.15
200	000830	鲁西化工	11,700	135,603.00	0.14
201	300383	光环新网	15,900	134,355.00	0.14
202	000708	中信特钢	9,800	132,986.00	0.14
203	000818	航锦科技	6,000	132,480.00	0.14
204	300373	扬杰科技	3,300	128,370.00	0.14
205	002756	永兴材料	3,570	127,734.60	0.13
206	002044	美年健康	33,628	127,113.84	0.13
207	300604	长川科技	4,600	124,982.00	0.13
208	000629	钒钛股份	49,800	124,500.00	0.13
209	300567	精测电子	2,200	124,322.00	0.13
210	300118	东方日升	10,200	123,420.00	0.13
211	000883	湖北能源	20,443	122,862.43	0.13
212	300442	润泽科技	5,100	122,145.00	0.13
213	000729	燕京啤酒	13,776	121,642.08	0.13
214	002841	视源股份	4,100	121,073.00	0.13
215	300253	卫宁健康	20,441	120,601.90	0.13
216	002429	兆驰股份	25,000	120,250.00	0.13
217	002430	杭氧股份	5,400	120,150.00	0.13

218	002508	老板电器	5,390	119,119.00	0.13
219	300487	蓝晓科技	2,850	119,016.00	0.13
220	000799	酒鬼酒	2,700	118,449.00	0.12
221	002120	韵达股份	15,166	117,384.84	0.12
222	300390	天华新能	6,780	116,480.40	0.12
223	002056	横店东磁	9,300	115,971.00	0.12
224	300568	星源材质	13,991	114,726.20	0.12
225	000887	中鼎股份	9,300	113,832.00	0.12
226	000998	隆平高科	11,548	113,516.84	0.12
227	002831	裕同科技	4,360	111,572.40	0.12
228	002372	伟星新材	7,200	111,024.00	0.12
229	002624	完美世界	14,600	110,960.00	0.12
230	002065	东华软件	24,460	110,559.20	0.12
231	300601	康泰生物	7,080	110,518.80	0.12
232	002414	高德红外	18,745	110,408.05	0.12
233	002926	华西证券	16,700	110,053.00	0.12
234	300979	华利集团	1,800	109,530.00	0.12
235	002507	涪陵榨菜	8,860	108,535.00	0.11
236	300765	新诺威	4,300	108,489.00	0.11
237	300763	锦浪科技	2,600	108,264.00	0.11
238	300803	指南针	2,900	105,589.00	0.11
239	000027	深圳能源	14,363	104,849.90	0.11
240	002500	山西证券	22,284	104,734.80	0.11
241	002203	海亮股份	13,000	103,740.00	0.11
242	002080	中材科技	8,000	103,200.00	0.11
243	002568	百润股份	6,124	103,066.92	0.11
244	002487	大金重工	4,500	102,960.00	0.11
245	002683	广东宏大	5,100	102,663.00	0.11
246	001286	陕西能源	8,900	102,617.00	0.11
247	002939	长城证券	15,300	102,510.00	0.11
248	002145	中核钛白	30,895	101,335.60	0.11
249	000893	亚钾国际	6,200	100,192.00	0.11
250	000155	川能动力	9,300	100,161.00	0.11
251	002557	洽洽食品	3,500	98,665.00	0.10
252	002572	索菲亚	6,400	98,112.00	0.10
253	300070	碧水源	23,221	97,295.99	0.10
254	000050	深天马A	13,303	96,845.84	0.10
255	002506	协鑫集成	49,900	96,806.00	0.10
256	301308	江波龙	1,000	94,740.00	0.10
257	300676	华大基因	2,700	94,527.00	0.10
258	300558	贝达药业	2,900	94,395.00	0.10
259	002299	圣农发展	6,899	94,102.36	0.10
260	002531	天顺风能	10,500	93,870.00	0.10

261	000739	普洛药业	6,800	92,276.00	0.10
262	300748	金力永磁	6,972	90,357.12	0.10
263	002244	滨江集团	12,300	89,298.00	0.09
264	002653	海思科	2,900	89,030.00	0.09
265	300595	欧普康视	5,620	88,121.60	0.09
266	000877	天山股份	16,100	86,940.00	0.09
267	000069	华侨城 A	42,581	86,865.24	0.09
268	000709	河钢股份	44,700	86,718.00	0.09
269	000825	太钢不锈	24,965	84,381.70	0.09
270	002607	中公教育	55,000	84,150.00	0.09
271	002032	苏泊尔	1,600	80,160.00	0.08
272	001227	兰州银行	33,300	79,254.00	0.08
273	003031	中瓷电子	1,640	75,833.60	0.08
274	002266	浙富控股	26,900	75,051.00	0.08
275	000800	一汽解放	9,400	73,602.00	0.08
276	000032	深桑达 A	4,900	73,402.00	0.08
277	300957	贝泰妮	1,500	72,480.00	0.08
278	002865	钧达股份	1,700	65,246.00	0.07
279	000987	越秀资本	12,943	64,197.28	0.07
280	000785	居然之家	24,300	59,049.00	0.06
281	002690	美亚光电	3,530	58,245.00	0.06
282	300888	稳健医疗	2,200	55,660.00	0.06
283	300682	朗新集团	6,500	55,315.00	0.06
284	002608	江苏国信	7,100	55,025.00	0.06
285	003035	南网能源	12,300	54,120.00	0.06
286	000958	电投产融	14,700	53,802.00	0.06
287	002153	石基信息	9,310	53,346.30	0.06
288	000898	鞍钢股份	24,963	52,921.56	0.06
289	001872	招商港口	2,700	51,975.00	0.05
290	000537	中绿电	5,400	51,462.00	0.05
291	000539	粤电力 A	9,800	49,784.00	0.05
292	003022	联泓新科	3,600	49,356.00	0.05
293	000401	冀东水泥	11,700	47,502.00	0.05
294	301035	润丰股份	1,000	44,540.00	0.05
295	000959	首钢股份	15,800	42,976.00	0.05
296	301267	华夏眼科	2,000	41,440.00	0.04
297	002945	华林证券	3,200	31,936.00	0.03
298	002461	珠江啤酒	4,200	31,164.00	0.03
299	001289	龙源电力	1,700	29,325.00	0.03
300	301165	锐捷网络	800	23,872.00	0.03

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	300573	兴齐眼药	260,962.00	0.29
2	000400	许继电气	236,840.00	0.26
3	002281	光迅科技	188,568.00	0.21
4	002436	兴森科技	188,543.00	0.21
5	300054	鼎龙股份	175,560.00	0.19
6	000921	海信家电	169,685.00	0.19
7	002984	森麒麟	149,520.00	0.17
8	000818	航锦科技	141,901.00	0.16
9	300765	新诺威	125,774.00	0.14
10	300803	指南针	120,182.00	0.13
11	002429	兆驰股份	119,306.00	0.13
12	301358	湖南裕能	115,420.00	0.13
13	001965	招商公路	82,565.00	0.09
14	000032	深桑达 A	75,200.00	0.08
15	001979	招商蛇口	65,005.00	0.07
16	000999	华润三九	62,681.00	0.07
17	002371	北方华创	61,568.00	0.07
18	300750	宁德时代	58,391.00	0.06
19	000425	徐工机械	53,602.00	0.06
20	002594	比亚迪	46,617.00	0.05

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	002497	雅化集团	112,216.00	0.12
2	000333	美的集团	110,777.00	0.12
3	300777	中简科技	98,224.00	0.11
4	300776	帝尔激光	82,139.40	0.09
5	300769	德方纳米	76,111.00	0.08

6	002541	鸿路钢构	74,946.00	0.08
7	002594	比亚迪	74,282.00	0.08
8	300438	鹏辉能源	72,972.00	0.08
9	000858	五粮液	67,932.00	0.08
10	300357	我武生物	67,424.00	0.07
11	000568	泸州老窖	65,594.00	0.07
12	002371	北方华创	63,294.00	0.07
13	000999	华润三九	59,982.00	0.07
14	300171	东富龙	56,364.00	0.06
15	002518	科士达	51,038.00	0.06
16	000725	京东方 A	49,608.00	0.05
17	000651	格力电器	48,872.00	0.05
18	002791	坚朗五金	47,399.00	0.05
19	300059	东方财富	43,832.00	0.05
20	300308	中际旭创	41,256.00	0.05

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	3,879,974.00
卖出股票收入（成交）总额	3,178,138.40

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 本基金投资股指期货的投资政策

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

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	235.29
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	235.29

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 (%)
2,327	33,712.50	51,149,460.00	65.20	27,299,531.00	34.80	44,847,842.00	57.17

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	广发证券股份有限公司	2,907,170.00	3.71
2	胡小彩	2,000,000.00	2.55
3	丘立峰	1,148,000.00	1.46
4	北京无限立通通讯技术有限责任公司	708,499.00	0.90
5	中信证券股份有限公司	662,857.00	0.84
6	冯国亮	650,000.00	0.83
7	上海旭兴投资管理有限公司-旭兴六号私募证券投资基金	630,000.00	0.80
8	肖松	606,000.00	0.77
9	简街香港有限公司-JSQB有限公司(R)	561,000.00	0.72

10	林少海	507,600.00	0.65
11	中国工商银行股份有限公司-汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	44,847,842.00	57.17

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	70,948,991.00
本报告期基金总申购份额	7,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	78,448,991.00

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，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。
本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：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况。

10.6.2 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	6	7,058,112.40	100.00	5,194.07	100.00	
财通证券	2	-	-	-	-	
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	1	-	-	-	-	

券						
国海证 券	2	-	-	-	-	
国联证 券	2	-	-	-	-	
国泰君 安	1	-	-	-	-	
国信证 券	2	-	-	-	-	
海通证 券	1	-	-	-	-	
恒泰证 券	2	-	-	-	-	
华安证 券	1	-	-	-	-	
华泰证 券	2	-	-	-	-	
摩根大 通证券	2	-	-	-	-	
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	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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公司投资研究总部/指数与量化投资部(合称“投资研究部门”)根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司,租用其交易单元。

(2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限,需符合相关法律法规规定的要求。(采用券商交易模式的

基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。)

(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门决定。

(6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 4 家证券公司的 7 个交易单元：摩根大通证券（上交所单元，深交所单元）、华安证券（上交所单元）、国联证券（深交所单元，上交所单元）、财通证券（深交所单元，上交所单元）；不再租用 1 家证券公司的 1 个交易单元：华西证券（上交所单元）。

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	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2024 年 01 月 02 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告	上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 10 日
3	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京增财基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 17 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 22 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分完全按照指数构成比例投资的基金修订基金合同关联交易限制条款的公告	证券时报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 07 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新法律文件	公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 07 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 08 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华金证券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, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 08 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关	上证报, 公司网站, 深	2024 年 03 月 28 日

	于提高旗下部分深市 ETF 现金替代退补款交收效率的公告	交所, 中国证监会基金电子披露网站	
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 29 日
11	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2024 年 3 月 29 日更新)	公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 29 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息资料的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 03 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富投资管理有限公司股东变更的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 16 日
14	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 22 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加财达证券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, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 03 日
16	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 07 日
17	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京中期时代基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 13 日
18	关于调整深证 300 交易型开放式指数证券投资基金主流动性服务商为一般流动性服务商的公告	证券时报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 22 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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

别		比例达到或者超过 20% 的时间区间					
中国工商银行股份有限公司-汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	39,917,842.00	8,217,800.00	3,287,800.00	44,847,842.00	57.17

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、转换运作方式或与其他基金合并。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

上海市黄浦区外马路 728 号 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

2024 年 08 月 30 日