

深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 08 月 29 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 2025 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 2025 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	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	18
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	56
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	56
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	56
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	56

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	58
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 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）	83,448,991.00
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	郭明
	联系电话	021-28932888	(010) 66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	(010) 66105798
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	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		鲁伟铭	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(2025 年 01 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	143,209.21
本期利润	848,539.84
加权平均基金份额本期利润	0.0094
本期加权平均净值利润率	0.68%
本期基金份额净值增长率	0.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	35,301,828.71

期末可供分配基金份额利润	0.4230
期末基金资产净值	118,750,819.71
期末基金份额净值	1.4230
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年06月30日)
基金份额累计净值增长率	42.30%

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。

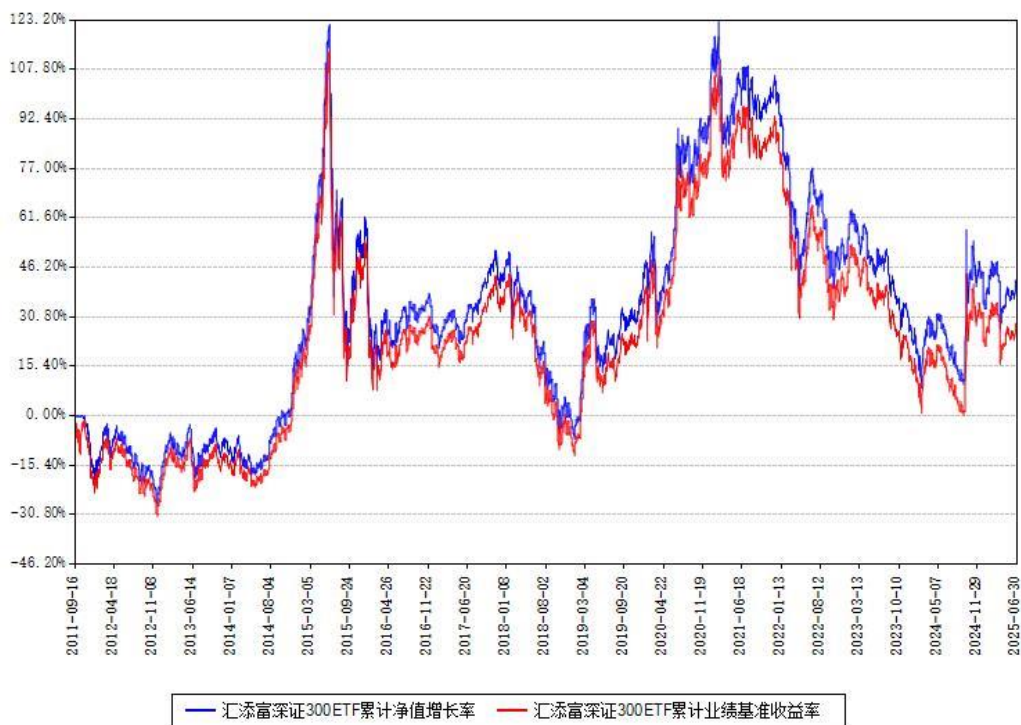
3.2 基金净值表现

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	4.48%	0.78%	3.98%	0.79%	0.50%	-0.01%
过去三个月	0.37%	1.45%	-0.53%	1.45%	0.90%	0.00%
过去六个月	0.57%	1.32%	-0.27%	1.32%	0.84%	0.00%
过去一年	17.72%	1.79%	16.15%	1.79%	1.57%	0.00%
过去三年	-18.83%	1.37%	-21.33%	1.38%	2.50%	-0.01%
自基金合同生效起至今	42.30%	1.52%	28.87%	1.55%	13.43%	-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。

2025 上半年，汇添富基金新成立 22 只公开募集证券投资基金。截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 363 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		
何丽竹	本基金的基金经理	2025 年 05 月 16 日	-	5	国籍：中国。学历：复旦大学金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2021 年 7 月起加入汇添富基金管理股份有限公司。2025 年 3 月 18 日至今任汇添富中证芯片产业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。2025 年 3 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。2025 年 3 月 21 日至今

					任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月 21 日至今任汇添富中证机器人交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月 30 日至今任汇添富中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月 13 日至今任汇添富国证自由现金流指数型证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月 16 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。2025 年 5 月 16 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
晏阳	本基金的基金经理	2023 年 05 月 22 日	2025 年 05 月 16 日	9	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

				<p>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 A100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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</p>
--	--	--	--	--

				<p>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。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 2025 年 5 月 16 日任深证 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</p>
--	--	--	--	--

				<p>年 7 月 11 日至 2025 年 1 月 22 日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 2025 年 3 月 21 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股东回报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。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。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。 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。2025 年 5 月 13 日至今 任汇添富国证 自由现金流指 数型证券投资 基金的基金经 理。2025 年 6 月 4 日至今任 汇添富中证油 气资源交易型 开放式指数证 券投资基金发 起式联接基金 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合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，力争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 4 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

2025 年上半年中国 A 股市场在海外关税政策变动、地缘冲突等影响下产生较大波动。

4 月初,美国宣布因巨额贸易逆差对贸易伙伴征收对等关税,全球主要市场均出现深度下跌。随着进入到部分国家暂缓执行状态,市场的极端悲观情绪开始缓和。A 股市场方面,中美首先互相加码,给市场带来了情绪压力;而后续博弈的缓和也使得 A 股市场进入修复阶段。5、6 月,关税谈判仍然是市场交易的主题之一。尽管相关风险偏好已经减弱,存在修复空间,但在美国司法挑战、伊以冲突等影响下,市场边际上涨的空间比较有限。

在外部扰动加大之时,国内经济基本面保持一定韧性,内需呈现稳中向好态势。1-6 月份,社会消费品零售总额同比增长 5.0%,同比增速与前值持平。消费的强劲表现主要得益于以旧换新政策、节假日促销及居民消费意愿回升。1-5 月固定资产投资完成额累计同比增长 3.7%,其中,基建投资和制造业投资同比分别增长 10.4%和 8.5%,保持较高增长;房地产投资同比下滑 11.1%,继续承压。外需方面,关税豁免窗口期结束,后续仍需持续关注。政策方面,国内政策保持积极有为,着力巩固经济向好基础。

2025 年上半年,上证指数上涨 2.76%,小盘表现优于大盘优于中盘,价值表现优于成长。行业主题方面,大金融表现突出,科技板块表现领先全市场。

本基金跟踪深证 300 指数,指数选取了深交所市值较大的 300 只股票作为指数样本,以表征深市整体表现。报告期内,本基金按照被动投资的原则,采用完全复制法,实现了对深证 300 指数的良好跟踪。

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 0.57%。同期业绩比较基准收益率为-0.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年 GDP 增速达 5.3%,高于去年同期,意味着全年增速目标的实现具备有力基础。从资金情绪来看,当下市场情绪和风险偏好整体较优,宽基指数也逐渐创下关税冲击以来新高,适合投资者积极寻找结构性机会。风格上,随着市场情绪整体改善,部分资金或切入科技成长等方向以获得高弹性的投资收益,若情绪持续,科技成长方向有望有积极表现。但红

利、自由现金流作为策略投资方法，有较好的投资有效性，在高质量发展阶段，关注资产本身的质量、盈利能力依旧是重要的投资思路，且在中长期有较好的收益体验，值得长期关注。

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 2025 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：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	650,788.58	478,854.14
结算备付金		-	4,240.82
存出保证金		1,143.98	2,953.50
交易性金融资产	6.4.7.2	118,220,467.74	138,980,306.90
其中：股票投资		118,214,767.37	138,964,027.19
基金投资		-	-
债券投资		5,700.37	16,279.71
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		14,675.96	92,442.50
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		118,887,076.26	139,558,797.86
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 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		-	106.15
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		49,743.47	63,238.48
应付托管费		9,948.69	12,647.71
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	76,564.39	189,157.73
负债合计		136,256.55	265,150.07
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	83,448,991.00	98,448,991.00
未分配利润	6.4.7.9	35,301,828.71	40,844,656.79
净资产合计		118,750,819.71	139,293,647.79
负债和净资产总计		118,887,076.26	139,558,797.86

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4230 元，基金份额总额 83,448,991.00 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：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		1,305,886.10	-4,063,396.94
1. 利息收入		806.78	602.58
其中：存款利息收入	6.4.7.10	806.78	602.58
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）		640,149.27	-171,355.20
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-852,460.57	-1,434,098.22
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	11,512.92	-

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	1,481,096.92	1,262,743.02
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	705,330.63	-3,893,641.40
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	-40,400.58	997.08
减：二、营业总支出		457,346.26	410,663.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	311,289.50	233,876.40
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	62,257.86	46,775.31
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		0.02	-
8. 其他费用	6.4.7.21	83,798.88	130,011.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		848,539.84	-4,474,060.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		848,539.84	-4,474,060.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		848,539.84	-4,474,060.33

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：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	98,448,991.00	40,844,656.79	139,293,647.79
加：会计政策变更	-	-	-

二、本期期初净资产	98,448,991.00	40,844,656.79	139,293,647.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,000,000.00	-5,542,828.08	-20,542,828.08
（一）、综合收益总额	-	848,539.84	848,539.84
（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）	-15,000,000.00	-6,391,367.92	-21,391,367.92
其中：1. 基金申购款	10,000,000.00	3,668,277.20	13,668,277.20
2. 基金赎回款	-25,000,000.00	-10,059,645.12	-35,059,645.12
（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	83,448,991.00	35,301,828.71	118,750,819.71
项目	上年度可比期间		
	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

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>张暉</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。经向中国证监会备案，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。

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、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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 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。

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征增值税试点的通知》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[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[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 2025 年 06 月 30 日
活期存款	650,788.58
等于：本金	650,725.14
加：应计利息	63.44
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	650,788.58

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	116,773,648.06	-	118,214,767.37	1,441,119.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	0.37	5,700.37	-
	银行间市场	-	-	-

	其他	-	-	-	-
	合计	5,700.00	0.37	5,700.37	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		116,779,348.06	0.37	118,220,467.74	1,441,119.31

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 2025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	1,436.72
其中：交易所市场	1,436.72
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	15,620.30
应付信息披露费	59,507.37

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	-
应付或有管理费	-
申购款利息	-
应付登记结算费	-
应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	-
合计	76,564.39

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,448,991.00	98,448,991.00
本期申购	10,000,000.00	10,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-25,000,000.00	-25,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	83,448,991.00	83,448,991.00

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	86,630,022.37	-45,785,365.58	40,844,656.79
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	86,630,022.37	-45,785,365.58	40,844,656.79
本期利润	143,209.21	705,330.63	848,539.84
本期基金份额交易产生的变动数	-13,194,895.25	6,803,527.33	-6,391,367.92
其中：基金申购款	8,800,916.32	-5,132,639.12	3,668,277.20

基金赎回款	-21,995,811.57	11,936,166.45	-10,059,645.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	73,578,336.33	-38,276,507.62	35,301,828.71

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
活期存款利息收入		785.07
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		17.34
其他		4.37
合计		806.78

注：“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-699,962.14
股票投资收益——赎回差价收入		-152,498.43
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		-852,460.57

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
卖出股票成交总额		4,022,461.28
减：卖出股票成本总额		4,717,844.34
减：交易费用		4,579.08
买卖股票差价收入		-699,962.14

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	

赎回基金份额对价总额	35,059,645.12
减：现金支付赎回款总额	-382,275.88
减：赎回股票成本总额	35,594,419.43
减：交易费用	-
赎回差价收入	-152,498.43

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

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	11.97
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	11,500.95
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	11,512.92

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	88,318.80
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	76,800.00
减：应计利息总额	14.31
减：交易费用	3.54
买卖债券差价收入	11,500.95

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
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,481,096.92
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	1,481,096.92

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	705,330.63
——股票投资	708,707.85
——债券投资	-3,377.22
——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	705,330.63

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

基金赎回费收入	-
替代损益	-40,400.58
其他	-
合计	-40,400.58

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	15,620.30
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	115.00
指数使用费	8,556.21
登记结算服务费	-
IOPV 计算与发布费	-
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	83,798.88

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人
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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	10,701,948.38	100.00	7,058,112.40	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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	88,318.80	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 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	1,882.23	100.00	1,436.72	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。截至 2024 年 6 月 30 日止，该类佣金协议的服务范围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等。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	311,289.50	233,876.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	32,881.12	-
应支付基金管理人的净管理费	278,408.38	233,876.40

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
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	62,257.86	46,775.31

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	51,039,142.00	61.16	52,707,942.00	53.54

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	650,788.58	785.07	372,944.64	561.94

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（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123257	安克转债	2025 年 06 月 16 日	14 个交易日	新债流通受限	100.00	100.01	57	5,700.00	5,700.37	

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 2025 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 2025 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 2025 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 2025 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	650,788.58	-	-	-	-	-	650,788.58
结算 备付	-	-	-	-	-	-	-

金							
存出 保证金	1,143.98	-	-	-	-	-	1,143.98
交易 性金 融资 产	-	-	5,700.37	-	-	118,214,767.37	118,220,467.74
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	14,675.96	14,675.96
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	651,932.56	-	5,700.37	-	-	118,229,443.33	118,887,076.26
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	-	-	-	-	-	49,743.47	49,743.47
应付 托管 费	-	-	-	-	-	9,948.69	9,948.69
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	-	-	-	-	-	76,564.39	76,564.39
负债 总计	-	-	-	-	-	136,256.55	136,256.55
利率 敏感 度缺 口	651,932.56	-	5,700.37	-	-	118,093,186.78	118,750,819.71
上年 度末 2024	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

年 12 月 31 日		月			上		
资产							
货币 资金	478,854.14	-	-	-	-	-	478,854.14
结算 备付 金	4,240.82	-	-	-	-	-	4,240.82
存出 保证 金	2,953.50	-	-	-	-	-	2,953.50
交易 性金 融资 产	-	-	16,279.71	-	-	138,964,027.19	138,980,306.90
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	92,442.50	92,442.50
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	486,048.46	-	16,279.71	-	-	139,056,469.69	139,558,797.86
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	-	-	-	-	-	106.15	106.15
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	63,238.48	63,238.48
应付托管费	-	-	-	-	-	12,647.71	12,647.71
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	-	-	-	-	-	189,157.73	189,157.73
负债	-	-	-	-	-	265,150.07	265,150.07

总计							
利率敏感 度缺口	486,048.46	-	16,279.71	-	-	138,791,319.62	139,293,647.79

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 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 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	118,214,767.37	99.55	138,964,027.19	99.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	5,700.37	0.00	16,279.71	0.01
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	118,220,467.74	99.55	138,980,306.90	99.78

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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	深证 300 指数 上涨 5%	5,923,366.27	6,947,505.19
	深证 300 指数 下跌 5%	-5,923,366.27	-6,947,505.19

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 2025 年 06 月 30 日
第一层次	118,214,767.37
第二层次	5,700.37
第三层次	-
合计	118,220,467.74

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售等情况，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 管理人报告-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	118,214,767.37	99.43
	其中：股票	118,214,767.37	99.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,700.37	0.00
	其中：债券	5,700.37	0.00
	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	650,788.58	0.55
8	其他各项资产	15,819.94	0.01
9	合计	118,887,076.26	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	2,600,772.65	2.19
B	采矿业	1,320,302.40	1.11
C	制造业	88,254,296.79	74.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,297,971.87	1.09
E	建筑业	101,150.00	0.09
F	批发和零售业	633,702.28	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	1,737,932.20	1.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,266,347.08	5.28
J	金融业	11,142,729.58	9.38
K	房地产业	1,110,882.08	0.94
L	租赁和商务服务业	962,982.40	0.81
M	科学研究和技术服务业	1,019,752.00	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	205,396.50	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	875,890.12	0.74
R	文化、体育和娱乐业	684,659.42	0.58
S	综合	-	-
	合计	118,214,767.37	99.55

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	31,028	7,825,882.16	6.59
2	000333	美的集团	59,284	4,280,304.80	3.60
3	300059	东方财富	150,984	3,492,259.92	2.94
4	002594	比亚迪	10,293	3,416,349.63	2.88
5	000858	五粮液	21,968	2,611,995.20	2.20
6	000651	格力电器	52,448	2,355,964.16	1.98
7	002475	立讯精密	56,388	1,956,099.72	1.65
8	000725	京东方 A	399,908	1,595,632.92	1.34
9	300124	汇川技术	23,952	1,546,580.64	1.30
10	300308	中际旭创	10,452	1,524,528.72	1.28
11	002371	北方华创	3,400	1,503,514.00	1.27
12	300760	迈瑞医疗	6,600	1,483,350.00	1.25
13	300502	新易盛	10,640	1,351,492.80	1.14
14	002352	顺丰控股	26,700	1,301,892.00	1.10
15	002714	牧原股份	30,289	1,272,440.89	1.07
16	002415	海康威视	45,511	1,262,020.03	1.06
17	000063	中兴通讯	38,383	1,247,063.67	1.05
18	000001	平安银行	102,221	1,233,807.47	1.04
19	300274	阳光电源	17,660	1,196,818.20	1.01
20	002142	宁波银行	41,270	1,129,147.20	0.95
21	002230	科大讯飞	23,385	1,119,673.80	0.94
22	300498	温氏股份	64,297	1,098,192.76	0.92
23	000568	泸州老窖	9,022	1,023,094.80	0.86
24	300476	胜宏科技	7,400	994,412.00	0.84
25	000100	TCL 科技	219,277	949,469.41	0.80
26	000338	潍柴动力	61,524	946,239.12	0.80
27	002027	分众传媒	121,888	889,782.40	0.75
28	000425	徐工机械	100,398	780,092.46	0.66
29	000792	盐湖股份	43,200	737,856.00	0.62
30	300014	亿纬锂能	15,218	697,136.58	0.59
31	002463	沪电股份	16,230	691,073.40	0.58
32	002241	歌尔股份	29,490	687,706.80	0.58
33	002050	三花智控	25,456	671,529.28	0.57
34	000625	长安汽车	52,375	668,305.00	0.56
35	002625	光启技术	16,700	667,666.00	0.56
36	300033	同花顺	2,432	663,960.32	0.56
37	300015	爱尔眼科	52,490	655,075.20	0.55
38	000977	浪潮信息	12,411	631,471.68	0.53
39	002384	东山精密	15,250	575,992.50	0.49

40	000776	广发证券	33,992	571,405.52	0.48
41	002179	中航光电	13,866	559,631.76	0.47
42	002311	海大集团	9,394	550,394.46	0.46
43	300433	蓝思科技	23,419	522,243.70	0.44
44	000938	紫光股份	21,758	521,974.42	0.44
45	000002	万 科 A	81,098	520,649.16	0.44
46	002049	紫光国微	7,885	519,306.10	0.44
47	300408	三环集团	15,100	504,340.00	0.42
48	002422	科伦药业	14,016	503,454.72	0.42
49	002028	思源电气	6,900	503,079.00	0.42
50	000538	云南白药	9,001	502,165.79	0.42
51	000166	申万宏源	98,606	495,002.12	0.42
52	000988	华工科技	10,246	481,664.46	0.41
53	002304	洋河股份	7,283	470,117.65	0.40
54	300339	润和软件	9,200	467,636.00	0.39
55	002460	赣锋锂业	13,520	456,570.40	0.38
56	000768	中航西飞	15,620	427,050.80	0.36
57	000157	中联重科	58,943	426,157.89	0.36
58	002074	国轩高科	12,987	421,558.02	0.35
59	002456	欧菲光	35,100	415,935.00	0.35
60	002966	苏州银行	47,170	414,152.60	0.35
61	300394	天孚通信	5,160	411,974.40	0.35
62	002517	恺英网络	21,300	411,303.00	0.35
63	002252	上海莱士	59,113	406,106.31	0.34
64	000807	云铝股份	25,100	401,098.00	0.34
65	002001	新 和 成	18,724	398,259.48	0.34
66	002466	天齐锂业	12,400	397,296.00	0.33
67	000975	山金国际	20,600	390,164.00	0.33
68	301236	软通动力	7,100	387,944.00	0.33
69	002736	国信证券	33,075	381,024.00	0.32
70	000963	华东医药	9,173	370,222.28	0.31
71	002340	格林美	58,203	369,589.05	0.31
72	000408	藏格矿业	8,600	366,962.00	0.31
73	000661	长春高新	3,690	365,974.20	0.31
74	002236	大华股份	22,945	364,366.60	0.31
75	001979	招商蛇口	41,471	363,700.67	0.31
76	002648	卫星化学	20,900	362,197.00	0.31
77	300661	圣邦股份	4,932	358,901.64	0.30
78	000066	中国长城	24,236	358,692.80	0.30
79	300803	指南针	4,395	354,500.70	0.30
80	002558	巨人网络	14,800	348,540.00	0.29
81	002156	通富微电	13,600	348,432.00	0.29
82	300418	昆仑万维	10,300	346,389.00	0.29

83	300251	光线传媒	16,906	342,684.62	0.29
84	300347	泰格医药	6,350	338,582.00	0.29
85	002797	第一创业	46,820	331,485.60	0.28
86	300450	先导智能	13,306	330,654.10	0.28
87	300207	欣旺达	16,400	328,984.00	0.28
88	002920	德赛西威	3,200	326,816.00	0.28
89	002916	深南电路	2,972	320,411.32	0.27
90	002202	金风科技	30,976	317,504.00	0.27
91	002465	海格通信	22,530	314,068.20	0.26
92	002185	华天科技	31,077	313,877.70	0.26
93	000895	双汇发展	12,818	312,887.38	0.26
94	000933	神火股份	18,600	309,504.00	0.26
95	003816	中国广核	84,300	306,852.00	0.26
96	002555	三七互娱	17,600	304,304.00	0.26
97	002601	龙佰集团	18,500	299,885.00	0.25
98	000831	中国稀土	8,300	299,796.00	0.25
99	302132	中航成飞	3,400	298,996.00	0.25
100	300782	卓胜微	4,178	298,183.86	0.25
101	002600	领益智造	34,100	292,919.00	0.25
102	002273	水晶光电	14,600	291,562.00	0.25
103	002595	豪迈科技	4,900	290,178.00	0.24
104	300866	安克创新	2,540	288,544.00	0.24
105	300442	润泽科技	5,800	287,274.00	0.24
106	000786	北新建材	10,844	287,149.12	0.24
107	002493	荣盛石化	34,650	286,902.00	0.24
108	300896	爱美客	1,640	286,688.40	0.24
109	002281	光迅科技	5,800	286,056.00	0.24
110	300458	全志科技	7,200	285,768.00	0.24
111	300759	康龙化成	11,450	280,983.00	0.24
112	002532	天山铝业	33,800	280,878.00	0.24
113	000630	铜陵有色	83,735	279,674.90	0.24
114	300474	景嘉微	3,800	277,400.00	0.23
115	000423	东阿阿胶	5,300	277,190.00	0.23
116	001965	招商公路	22,900	274,800.00	0.23
117	002294	信立泰	5,802	274,608.66	0.23
118	300454	深信服	2,900	273,122.00	0.23
119	002129	TCL 中环	35,411	271,956.48	0.23
120	300223	北京君正	3,900	269,880.00	0.23
121	002180	纳思达	11,700	268,398.00	0.23
122	300122	智飞生物	13,700	268,383.00	0.23
123	002472	双环传动	8,000	267,920.00	0.23
124	300017	网宿科技	24,900	266,928.00	0.22
125	000034	神州数码	7,000	263,480.00	0.22

126	000783	长江证券	37,899	262,640.07	0.22
127	002709	天赐材料	14,460	262,015.20	0.22
128	300395	菲利华	5,100	260,610.00	0.22
129	301269	华大九天	2,100	260,148.00	0.22
130	002085	万丰奥威	16,100	255,829.00	0.22
131	002078	太阳纸业	18,900	254,394.00	0.21
132	000426	兴业银锡	16,100	254,380.00	0.21
133	002223	鱼跃医疗	7,126	253,685.60	0.21
134	002938	鹏鼎控股	7,900	253,037.00	0.21
135	000728	国元证券	32,048	252,858.72	0.21
136	002353	杰瑞股份	7,211	252,385.00	0.21
137	002851	麦格米特	5,000	250,700.00	0.21
138	300024	机器人	14,400	247,392.00	0.21
139	300496	中科创达	4,300	246,046.00	0.21
140	002738	中矿资源	7,620	245,059.20	0.21
141	002065	东华软件	25,460	244,416.00	0.21
142	300115	长盈精密	11,400	243,960.00	0.21
143	002008	大族激光	9,940	242,237.80	0.20
144	300383	光环新网	16,900	241,670.00	0.20
145	000733	振华科技	4,800	240,240.00	0.20
146	000021	深科技	12,800	239,872.00	0.20
147	002436	兴森科技	18,100	239,644.00	0.20
148	000999	华润三九	7,659	239,573.52	0.20
149	000876	新希望	25,506	239,246.28	0.20
150	002271	东方雨虹	22,270	238,957.10	0.20
151	300054	鼎龙股份	8,300	238,044.00	0.20
152	002850	科达利	2,100	237,657.00	0.20
153	002128	电投能源	11,800	233,404.00	0.20
154	002673	西部证券	29,602	233,263.76	0.20
155	000301	东方盛虹	28,000	233,240.00	0.20
156	300765	新诺威	4,500	232,605.00	0.20
157	000617	中油资本	31,600	230,680.00	0.19
158	002138	顺络电子	8,200	230,584.00	0.19
158	002624	完美世界	15,200	230,584.00	0.19
160	002157	正邦科技	84,300	230,139.00	0.19
161	002405	四维图新	26,691	227,941.14	0.19
162	300832	新产业	4,000	226,880.00	0.19
163	000596	古井贡酒	1,700	226,355.00	0.19
164	300604	长川科技	5,000	224,550.00	0.19
165	002410	广联达	16,594	222,525.54	0.19
166	000519	中兵红箭	10,100	221,089.00	0.19
167	002459	晶澳科技	21,724	216,805.52	0.18
168	300073	当升科技	4,900	214,963.00	0.18

169	300142	沃森生物	19,500	214,500.00	0.18
170	002821	凯莱英	2,420	213,565.00	0.18
171	002444	巨星科技	8,300	211,733.00	0.18
172	000878	云南铜业	16,623	211,444.56	0.18
173	000932	华菱钢铁	47,580	209,352.00	0.18
174	002152	广电运通	15,460	207,782.40	0.17
175	000750	国海证券	50,249	207,025.88	0.17
176	300001	特锐德	8,600	206,142.00	0.17
177	002812	恩捷股份	7,030	205,908.70	0.17
178	300003	乐普医疗	14,806	204,026.68	0.17
179	300699	光威复材	6,420	203,321.40	0.17
180	300037	新宙邦	5,740	202,048.00	0.17
181	300316	晶盛机电	7,400	200,910.00	0.17
182	300999	金龙鱼	6,800	200,804.00	0.17
183	002414	高德红外	19,445	199,311.25	0.17
184	000893	亚钾国际	6,600	198,924.00	0.17
185	300012	华测检测	16,900	197,561.00	0.17
186	300628	亿联网络	5,660	196,741.60	0.17
187	000983	山西焦煤	30,401	194,566.40	0.16
188	002007	华兰生物	12,177	190,813.59	0.16
189	001696	宗申动力	8,400	188,580.00	0.16
190	000729	燕京啤酒	14,376	185,881.68	0.16
191	000009	中国宝安	20,832	184,988.16	0.16
192	000623	吉林敖东	10,861	184,093.95	0.16
193	300373	扬杰科技	3,500	181,650.00	0.15
194	002044	美年健康	35,128	180,557.92	0.15
195	002409	雅克科技	3,300	180,477.00	0.15
196	300558	贝达药业	3,100	179,645.00	0.15
197	000528	柳工	18,500	177,785.00	0.15
198	002318	久立特材	7,600	177,764.00	0.15
199	002739	万达电影	15,500	177,165.00	0.15
200	002683	广东宏大	5,200	176,488.00	0.15
201	000960	锡业股份	11,525	176,332.50	0.15
202	300724	捷佳伟创	3,200	173,760.00	0.15
203	300748	金力永磁	7,272	173,364.48	0.15
204	000738	航发控制	8,348	173,221.00	0.15
205	000887	中鼎股份	9,800	172,382.00	0.15
206	000400	许继电气	7,800	169,806.00	0.14
207	002025	航天电器	3,300	169,653.00	0.14
208	002385	大北农	41,487	167,607.48	0.14
209	300144	宋城演艺	19,276	164,809.80	0.14
210	300285	国瓷材料	9,400	163,090.00	0.14
211	300919	中伟股份	4,960	163,084.80	0.14

212	300413	芒果超媒	7,460	162,777.20	0.14
213	002080	中材科技	8,300	161,850.00	0.14
214	002568	百润股份	6,224	159,396.64	0.13
215	002841	视源股份	4,600	159,160.00	0.13
216	002926	华西证券	17,600	157,344.00	0.13
217	000513	丽珠集团	4,343	156,521.72	0.13
218	300763	锦浪科技	2,700	154,953.00	0.13
219	000683	博源化工	31,300	149,927.00	0.13
220	301358	湖南裕能	4,800	149,712.00	0.13
221	002312	川发龙蟒	13,000	149,240.00	0.13
222	000723	美锦能源	34,500	149,040.00	0.13
223	300487	蓝晓科技	2,950	148,385.00	0.12
224	300676	华大基因	2,900	144,333.00	0.12
225	002056	横店东磁	10,000	141,500.00	0.12
226	000591	太阳能	32,000	140,480.00	0.12
227	300567	精测电子	2,300	139,403.00	0.12
228	002064	华峰化学	20,900	138,149.00	0.12
229	000155	川能动力	14,000	137,480.00	0.12
230	000703	恒逸石化	23,310	137,062.80	0.12
231	002500	山西证券	23,284	135,978.56	0.11
232	002756	永兴材料	4,270	135,572.50	0.11
233	002262	恩华药业	6,500	135,070.00	0.11
234	002203	海亮股份	13,000	134,160.00	0.11
235	300146	汤臣倍健	11,888	133,621.12	0.11
236	000629	钒钛股份	52,100	133,376.00	0.11
237	002939	长城证券	15,900	133,242.00	0.11
238	300390	天华新能	6,980	133,108.60	0.11
239	002439	启明星辰	8,320	133,036.80	0.11
240	002603	以岭药业	9,380	132,258.00	0.11
241	002423	中粮资本	10,800	132,084.00	0.11
242	002653	海思科	3,100	130,882.00	0.11
243	000050	深天马A	15,303	130,381.56	0.11
244	002984	森麒麟	6,900	129,375.00	0.11
245	000958	电投产融	18,900	129,276.00	0.11
246	002244	滨江集团	13,200	128,700.00	0.11
247	000921	海信家电	5,000	128,500.00	0.11
248	002145	中核钛白	30,795	127,799.25	0.11
249	000830	鲁西化工	12,100	124,630.00	0.10
250	000799	酒鬼酒	2,800	123,172.00	0.10
251	300751	迈为股份	1,744	121,312.64	0.10
252	301536	星辰科技	2,000	120,600.00	0.10
253	000708	中信特钢	10,200	119,952.00	0.10
254	300070	碧水源	25,521	114,844.50	0.10

255	002429	兆驰股份	26,100	114,318.00	0.10
256	300601	康泰生物	7,480	113,621.20	0.10
257	000598	兴蓉环境	15,700	113,197.00	0.10
258	300529	健帆生物	5,210	112,379.70	0.09
259	301498	乖宝宠物	1,000	109,370.00	0.09
260	002831	裕同科技	4,660	109,137.20	0.09
261	002430	杭氧股份	5,600	108,752.00	0.09
262	002120	韵达股份	15,766	105,632.20	0.09
263	301308	江波龙	1,200	104,988.00	0.09
264	002508	老板电器	5,490	104,364.90	0.09
265	000032	深桑达A	5,000	101,150.00	0.09
266	002299	圣农发展	6,999	100,015.71	0.08
267	000709	河钢股份	46,100	99,576.00	0.08
268	000739	普洛药业	7,100	99,400.00	0.08
269	003031	中瓷电子	1,840	97,906.40	0.08
270	000069	华侨城A	43,481	97,832.25	0.08
271	300957	贝泰妮	2,200	97,284.00	0.08
272	000987	越秀资本	14,143	97,020.98	0.08
273	000027	深圳能源	14,963	95,463.94	0.08
274	300979	华利集团	1,800	94,626.00	0.08
275	000883	湖北能源	20,843	94,001.93	0.08
276	000825	太钢不锈	26,165	93,932.35	0.08
277	301301	川宁生物	7,800	93,912.00	0.08
278	000800	一汽解放	13,500	92,610.00	0.08
279	002266	浙富控股	29,400	90,552.00	0.08
280	300888	稳健医疗	2,200	90,420.00	0.08
281	002153	石基信息	9,710	84,088.60	0.07
282	002032	苏泊尔	1,600	83,824.00	0.07
283	002372	伟星新材	7,600	78,736.00	0.07
284	000877	天山股份	16,800	77,952.00	0.07
285	301165	锐捷网络	1,260	77,439.60	0.07
286	001286	陕西能源	8,700	75,690.00	0.06
287	000785	居然智家	24,000	73,200.00	0.06
288	000937	冀中能源	12,400	71,300.00	0.06
289	003022	联泓新科	4,400	69,652.00	0.06
290	000537	中绿电	8,200	68,552.00	0.06
291	002608	江苏国信	8,900	65,237.00	0.05
292	000898	鞍钢股份	26,163	60,698.16	0.05
293	003035	南网能源	12,700	58,293.00	0.05
294	000959	首钢股份	16,400	55,760.00	0.05
295	001872	招商港口	2,800	55,608.00	0.05
296	002461	珠江啤酒	4,400	49,676.00	0.04
297	002945	华林证券	3,400	48,858.00	0.04

298	000539	粤电力 A	10,100	45,854.00	0.04
299	301267	华夏眼科	2,100	40,257.00	0.03
300	001289	龙源电力	1,600	25,888.00	0.02

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产 净值比例 (%)
1	300458	全志科技	296,367.10	0.21
2	300017	网宿科技	270,630.00	0.19
3	002085	万丰奥威	269,713.00	0.19
4	000034	神州数码	268,377.00	0.19
5	300024	机器人	251,256.00	0.18
6	300115	长盈精密	250,430.00	0.18
7	002851	麦格米特	241,289.00	0.17
8	001696	宗申动力	190,221.00	0.14
9	002312	川发龙蟒	158,424.00	0.11
10	301536	星辰科技	139,490.00	0.10
11	300124	汇川技术	89,794.00	0.06
12	300896	爱美客	89,061.00	0.06
13	002966	苏州银行	87,368.00	0.06
14	300033	同花顺	86,594.00	0.06
15	000651	格力电器	84,865.00	0.06
16	000596	古井贡酒	83,490.00	0.06
17	002142	宁波银行	73,413.00	0.05
18	300750	宁德时代	69,767.00	0.05
19	300474	景嘉微	67,856.00	0.05
20	002475	立讯精密	67,570.00	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	300750	宁德时代	226,947.00	0.16
2	002487	大金重工	161,898.00	0.12
3	002407	多氟多	160,367.00	0.12
4	000818	航锦科技	147,088.00	0.11
5	300573	兴齐眼药	143,368.00	0.10
6	000998	隆平高科	129,720.48	0.09
7	002507	涪陵榨菜	127,927.80	0.09
8	002572	索菲亚	105,502.00	0.08
9	300595	欧普康视	95,114.00	0.07
10	002557	洽洽食品	91,080.00	0.07
11	002531	天顺风能	82,637.00	0.06
12	000792	盐湖股份	78,744.00	0.06
13	002594	比亚迪	61,391.00	0.04
14	000166	申万宏源	50,798.00	0.04
15	000333	美的集团	50,574.00	0.04
16	300059	东方财富	49,480.00	0.04
17	300308	中际旭创	44,115.00	0.03
18	300442	润泽科技	43,163.00	0.03
19	000651	格力电器	40,375.00	0.03
20	002049	紫光国微	39,310.00	0.03

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,679,487.10
卖出股票收入（成交）总额	4,022,461.28

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,700.37	0.00
8	同业存单	-	-

9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	5,700.37	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123257	安克转债	57	5,700.37	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 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	1,143.98
2	应收清算款	14,675.96
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	15,819.94

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 (%)
2,572	32,445.18	56,208,600.00	67.36	27,240,391.00	32.64	51,039,142.00	61.16

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	1,948,586.00	2.34
2	中信证券股份有限公司	1,246,058.00	1.49
3	张欣	874,600.00	1.05
4	王学军	774,700.00	0.93
5	北京无限立通通讯技术有限责任公司	708,499.00	0.85
6	中国工商银行股份有限公司—华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金（FOF—LOF）	582,713.00	0.70
7	何文龙	412,200.00	0.49
8	付利利	405,700.00	0.49
9	李莉	391,900.00	0.47
10	赵刚	391,400.00	0.47
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	51,039,142.00	61.16

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	98,448,991.00
本报告期基金总申购份额	10,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	25,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	83,448,991.00

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	10,701,948.38	100.00	1,882.23	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	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国海证券	2	-	-	-	-	
国联证券	2	-	-	-	-	
国泰海通	6	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
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	3	-	-	-	-	
瑞银证券	2	-	-	-	-	
申万宏源证券	3	-	-	-	-	
信达证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	3	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	
中金财富	2	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信建投证券	3	-	-	-	-	
中信证券	4	-	-	-	-	

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

				比例 (%)		(%)		(%)
东方 证券	88,318.80	100.00	-	-	-	-	-	-
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 海通	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 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	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 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 7 家证券公司的 15 个交易单元:中信建投证券(深交所单元,上交所单元)、中信证券(上交所单元,深交所单元)、申万宏源证券(深交所单元,上交所单元)、兴业证券(上交所单元,深交所单元)、中金财富(深交所单元,上交所单元)、平安证券(深交所单元)、国泰海通(上交所单元,深交所单元,深交所单元,上交所单元);不再租用 1

家证券公司的 2 个交易单元：太平洋证券（上交所单元，深交所单元）。

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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东北证券为申购赎回代理券商的公告	上证报, 上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 07 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第四季度报告	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报	2025 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加国盛证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 深交所, 证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 12 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东吴证券为申购赎回代理券商的公告	上证报, 上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 13 日
5	关于汇添富基金管理股份有限公司旗下部分指数基金指数许可使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	上证报, 上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 20 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, 中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所	2025 年 03 月 20 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	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 21 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新产品资料概要	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 21 日
9	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所, 上证报	2025 年 03 月 31 日
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年年报	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 31 日
11	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第一季度报告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中	2025 年 04 月 22 日

		国证监会基金电子披露网站	
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券为申购赎回代理券商的公告	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报, 上交所, 深交所	2025 年 04 月 30 日
13	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2025 年 05 月 17 日
14	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2025 年 5 月 21 日更新)	深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 05 月 21 日
15	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与民商基金销售(上海)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	2025 年 06 月 16 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加瑞银证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 23 日
17	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与大华银行(中国)有限公司合作关系的公告	上证报, 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站	2025 年 06 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		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	1	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	52,707,942.00	4,932,600.00	6,601,400.00	51,039,142.00	61.16

基金							
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

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

2025 年 08 月 29 日