深证 300 交易型开放式指数证券投资基金
2026 年中期报告

2026 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：2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 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遵规守信情况的说明 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 17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 18
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 18
§5 托管人报告 18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 18
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 18
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 19
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 19
6.1 资产负债表 19
6.2 利润表 20
6.3 净资产变动表 21
6.4 报表附注 23
§7 投资组合报告 43
7.1 期末基金资产组合情况 43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 44
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 44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 54
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 54
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 54
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 54
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 54

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....54
7.12 投资组合报告附注.....54
§8 基金份额持有人信息.....55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....56
§9 开放式基金份额变动.....56
§10 重大事件揭示.....56
10.1 基金份额持有人大会决议.....56
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.....56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....57
10.4 基金投资策略的改变.....57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....57
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....57
10.8 其他重大事件.....60
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....61
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.....61
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.....63
12.3 查阅方式.....63

§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 汇添富
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）	58,448,991.00
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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告置备地点	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(2026年01月01日 - 2026年06月30日)
本期已实现收益	17,625,320.27
本期利润	25,442,284.32
加权平均基金份额本期利润	0.3795
本期加权平均净值利润率	19.00%
本期基金份额净值增长率	20.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026年06月30日)
期末可供分配利润	72,247,444.56
期末可供分配基金份额利润	1.2361

期末基金资产净值	130,696,435.56
期末基金份额净值	2.2361
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	123.61%

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
过去三个月	21.51%	1.71%	21.04%	1.72%	0.47%	-0.01%
过去六个月	20.49%	1.51%	20.16%	1.52%	0.33%	-0.01%
过去一年	57.14%	1.40%	56.11%	1.41%	1.03%	-0.01%
过去三年	50.61%	1.47%	46.08%	1.48%	4.53%	-0.01%
过去五年	7.19%	1.39%	2.46%	1.39%	4.73%	0.00%
过去七年	83.66%	1.42%	75.12%	1.42%	8.54%	0.00%
过去十年	72.35%	1.38%	64.14%	1.39%	8.21%	-0.01%
自基金合同生效起至今	123.61%	1.52%	101.17%	1.54%	22.44%	-0.02%

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

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、汇添富基金销售（上海）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、公募证券投资基金销售等业务资格。

汇添富基金自成立以来，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

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。

2026 上半年，汇添富基金新成立 30 只公开募集证券投资基金。截至 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 421 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		
李雅楠	本基金的基金经理	2026 年 06 月 29 日	-	6	国籍：中国。学历：清华大学应用统计硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2021 年 6 月至 2023 年 10 月在兴银理财有限责任公司工作，2023 年 10 月至 2026 年 1 月在平安理财有限责任公司工作。2026 年 1 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2026 年 6 月 29 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。2026 年 6 月 29 日至今任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月 29 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。2026 年 6 月 29 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。2026 年 6 月 29 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。
何丽竹	本基金的基金经理	2025 年 05 月 16 日	2026 年 06 月 29 日	6	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 2026 年 6 月 29 日任汇添富深证 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 2025 年 7 月 28 日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 2026 年 6 月 29 日任深证 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。2025 年 7 月 15 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发起式联接基金的基金经理。2025 年 7 月 17 日至今任汇添富国证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 7 月 28 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月 29 日至今任汇添富国证自由现金流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 8 月 5 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联接基金的基金经理。2025 年 8 月 18 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发起式联接基金的基金经理。2025 年 8 月 18 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业交易型开

					放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 8 月 18 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。2025 年 8 月 25 日至今任汇添富上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 29 日至今任汇添富中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 2 月 9 日至今任汇添富上证科创板人工智能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。2026 年 4 月 20 日至今任汇添富国证消费电子主题交易型开放式指

					数证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月 28 日至今任汇添富中证金融科技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。2026 年 5 月 27 日至今任汇添富国证价值 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

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，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和流程，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中的公平交易模块，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1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，国内宏观经济总量运行平稳，GDP增速基本符合年度预期增长目标。全球宏观环境迎来多重变局：海外基本面新旧动能分化加剧，发达经济体复苏不一；美伊冲突等地缘政治升温，扰动市场风险偏好，加剧全球增长和通胀前景的不确定性。面对复杂外部，中国经济总体保持韧性，名义增长由负转正，通缩压力缓解；出口凭借产业链优势持续提升竞争力，同时以人工智能为代表的新经济引领地位进一步夯实。国内经济动能切换，结构分

化显著。外需受益于全球补库与竞争力强化而持续向好，内需则因居民收入预期偏弱及地产修复缓慢而相对不足。高技术制造、出口链和新兴产业投资景气度再超预期，展现出强弹性；而建筑业、传统制造业部门及居民部门资产负债表仍处于弱复苏阶段。

资本市场方面，上半年国内权益市场整体震荡上行，但节奏波动加大，行情呈现 K 型分化。全球科技产业链在 AI 与半导体周期共振下，供需关系趋紧，盈利预期处于较强状态。作为宏观经济结构背离的映射，科技与高端制造行业强势领跑，地产、消费等传统板块则持续承压。风格维度上，上半年成长风格相对价值风格显著占优，资金向高景气赛道高度集中。

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，本基金遵循被动指数投资原则，采用完全复制法，实现了对标的指数的良好跟踪。

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 20.49%，同期业绩比较基准收益率为 20.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济总量稳中向好、结构分化的趋势有望延续。在外需韧性与新动能增强支撑下，内需渐进修复，分化格局短期难改。新经济对增长的拉动作用日益增强，特别是 AI 革命正激发从算力基础设施到终端应用的大规模资本开支，有望带动全要素生产率再次跃升，为长期增长注入动力。同时，传统能源供给脆弱性凸显，进一步强化了电力和新能源的战略安全价值，将推动相关产业链在盈利、产能和出口份额上实现快速扩张。宏观政策层面，预计将在年度既定资源框架内强化逆周期调节，重点加快专项债、财政支出等存量政策落地，以巩固经济回升向好态势。

映射到资本市场，下半年国内权益资产仍具备较好配置价值。基本面来看，A 股即将步入库存周期与产能周期的共振向上阶段，当前工业企业库存已处低位，产能周期开启，盈利修复动能增强。TMT 与先进制造是此前盈利恢复的核心引擎，AI 算力、半导体等景气有望延续；叠加通胀温和回升，中下游企业利润率改善可期。估值维度，主要宽基指数风险溢价处于历史合理分位，股债性价比凸显。流动性与资金面维度，国内货币政策维持呵护基调，资本市场制度完善与长线资金入市机制加速，叠加海外流动性拐点渐近，市场增量资金前景可期。

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偏离，实现对标的指数的紧密跟踪。

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 2026 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：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	887,364.44	908,165.60
结算备付金		4,489.31	-
存出保证金		647.28	690.73
交易性金融资产	6.4.7.2	129,942,926.25	140,276,020.23
其中：股票投资		129,942,926.25	140,276,020.23
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		130,835,427.28	141,184,876.56
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 06 月 30 日**	**上年度末 2025 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		-	13,597.22
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		52,500.25	62,443.44
应付托管费		10,500.06	12,488.67
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	75,991.41	148,957.63
负债合计		138,991.72	237,486.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	58,448,991.00	75,948,991.00
未分配利润	6.4.7.9	72,247,444.56	64,998,398.60
净资产合计		130,696,435.56	140,947,389.60
负债和净资产总计		130,835,427.28	141,184,876.56

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.2361 元，基金份额总额 58,448,991.00 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：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		**25,912,549.29**	**1,305,886.10**
1.利息收入		1,472.62	806.78
其中：存款利息收入	6.4.7.10	1,472.62	806.78
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）		18,077,211.06	640,149.27
其中：股票投资收益	6.4.7.11	17,079,864.43	-852,460.57
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	997,346.63	1,481,096.92
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	7,816,964.05	705,330.63
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	16,901.56	-40,400.58
减：二、营业总支出		**470,264.97**	**457,346.26**
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	331,040.86	311,289.50
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	66,208.17	62,257.86
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	73,015.94	83,798.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**25,442,284.32**	**848,539.84**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**25,442,284.32**	**848,539.84**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**25,442,284.32**	**848,539.84**

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：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 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	75,948,991.00	64,998,398.60	140,947,389.60
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净	75,948,991.00	64,998,398.60	140,947,389.60

资产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17,500,000.00	7,249,045.96	-10,250,954.04
（一）、综合收益总额	-	25,442,284.32	25,442,284.32
（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）	-17,500,000.00	-18,193,238.36	-35,693,238.36
其中：1.基金申购款	17,500,000.00	16,708,430.24	34,208,430.24
2.基金赎回款	-35,000,000.00	-34,901,668.60	-69,901,668.60
（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	72,247,444.56	130,696,435.56

项目	上年度可比期间 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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

深证 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2011〕886 号文《关于核准汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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>》，中国证

券投资基金业协会发布的《公开募集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2026年06月30日的财务状况以及2026年01月01日至2026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‰；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、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。

2.增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告2026年第10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自2026年1月1日至2027年12月31日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（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、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局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《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《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《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 2026 年 06 月 30 日
活期存款	887,364.44
等于：本金	887,292.59
加：应计利息	71.85
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	887,364.44

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		93,469,948.47	-	129,942,926.25	36,472,977.78
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		93,469,948.47	-	129,942,926.25	36,472,977.78

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 2026 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	3,095.47
其中：交易所市场	3,095.47
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	13,388.57
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	75,991.41

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	75,948,991.00	75,948,991.00
本期申购	17,500,000.00	17,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-35,000,000.00	-35,000,000.00
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	58,448,991.00	58,448,991.00

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	75,978,892.55	-10,980,493.95	64,998,398.60
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	75,978,892.55	-10,980,493.95	64,998,398.60
本期利润	17,625,320.27	7,816,964.05	25,442,284.32
本期基金份额交易产生的变动数	-19,607,616.67	1,414,378.31	-18,193,238.36
其中：基金申购款	18,911,754.57	-2,203,324.33	16,708,430.24
基金赎回款	-38,519,371.24	3,617,702.64	-34,901,668.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	73,996,596.15	-1,749,151.59	72,247,444.56

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日

活期存款利息收入	1,455.47
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	15.80
其他	1.35
合计	1,472.62

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,090,434.98
股票投资收益——赎回差价收入	15,989,429.45
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	17,079,864.43

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	9,655,656.12
减：卖出股票成本总额	8,555,400.48
减：交易费用	9,820.66
买卖股票差价收入	1,090,434.98

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	69,901,668.60
减：现金支付赎回款总额	53,179.60
减：赎回股票成本总额	53,859,059.55
减：交易费用	-
赎回差价收入	15,989,429.45

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。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.14 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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	997,346.63
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	997,346.63

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1.交易性金融资产	7,816,964.05

——股票投资	7,816,964.05
——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	7,816,964.05

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	16,901.56
其他	-
合计	16,901.56

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	13,388.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	120.00
指数使用费	-
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	73,015.94

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、关联关系

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
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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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 2026 年 01 月 01 日至 2026 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（%）
	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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

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。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	331,040.86	311,289.50
其中：应支付销售机构的客户维护费	27,745.36	32,881.12
应支付基金管理人的净管理费	303,295.50	278,408.38

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×0.50%÷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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	66,208.17	62,257.86

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×0.10%÷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 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 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	42,292,042.00	72.36	50,185,842.00	66.08

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	887,364.44	1,455.47	650,788.58	785.07

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（2026 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 2026 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 2026 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 2026 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 2026 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	887,364.44	-	-	-	-	-	887,364.44
结算备付金	4,489.31	-	-	-	-	-	4,489.31
存出保证金	647.28	-	-	-	-	-	647.28
交易性金融资产	-	-	-	-	-	129,942,926.25	129,942,926.25
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	892,501.03	-	-	-	-	129,942,926.25	130,835,427.28
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	-	-	-	-	-	52,500.25	52,500.25
应付托管费	-	-	-	-	-	10,500.06	10,500.06
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	-	-	-	-	-	75,991.41	75,991.41
负债总计	-	-	-	-	-	138,991.72	138,991.72
利率敏感度缺口	892,501.03	-	-	-	-	129,803,934.53	130,696,435.56
上年度末 2025 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	908,165.60	-	-	-	-	-	908,165.60
结算备付	-	-	-	-	-	-	-

金							
存出保证金	690.73	-	-	-	-	-	690.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	140,276,020.23	140,276,020.23
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	908,856.33	-	-	-	-	140,276,020.23	141,184,876.56
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	-	-	-	-	-	13,597.22	13,597.22
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	62,443.44	62,443.44
应付托管费	-	-	-	-	-	12,488.67	12,488.67
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	-	-	-	-	-	148,957.63	148,957.63
负债总计	-	-	-	-	-	237,486.96	237,486.96
利率敏感度缺口	908,856.33	-	-	-	-	140,038,533.27	140,947,389.60

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 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 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	129,942,926.25	99.42	140,276,020.23	99.52
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	129,942,926.25	99.42	140,276,020.23	99.52

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	深证 300 指数上涨 5%	6,505,943.40	7,024,038.22
	深证 300 指数下跌 5%	-6,505,943.40	-7,024,038.22

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

6.4.14 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 2026 年 06 月 30 日
第一层次	129,942,926.25
第二层次	-
第三层次	-

合计	129,942,926.25

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 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	129,942,926.25	99.32
	其中：股票	129,942,926.25	99.32
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	891,853.75	0.68
8	其他各项资产	647.28	0.00
9	合计	130,835,427.28	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	1,385,495.15	1.06
B	采矿业	1,373,927.80	1.05
C	制造业	109,389,297.04	83.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	717,758.36	0.55
E	建筑业	119,760.00	0.09
F	批发和零售业	1,246,947.76	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	802,990.00	0.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,118,275.67	3.92
J	金融业	7,064,479.66	5.41
K	房地产业	400,557.61	0.31
L	租赁和商务服务业	987,852.92	0.76
M	科学研究和技术服务业	575,867.50	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	107,778.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	413,722.24	0.32
R	文化、体育和娱乐业	238,216.54	0.18
S	综合	-	-
	合计	129,942,926.25	99.42

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	300308	中际旭创	6,852	8,702,040.00	6.66
2	300750	宁德时代	20,628	8,107,010.28	6.20
3	300502	新易盛	9,836	5,970,452.00	4.57
4	000333	美的集团	38,084	2,876,484.52	2.20
5	002371	北方华创	3,135	2,773,095.60	2.12
6	002384	东山精密	9,950	2,610,382.50	2.00
7	002475	立讯精密	36,888	2,596,915.20	1.99
8	000725	京东方Ａ	256,708	2,228,225.44	1.70
9	300059	东方财富	101,084	2,060,091.92	1.58
10	300274	阳光电源	11,660	1,854,173.20	1.42
11	300476	胜宏科技	4,800	1,662,864.00	1.27
12	300408	三环集团	9,900	1,652,310.00	1.26
13	002463	沪电股份	10,730	1,639,544.00	1.25
14	002594	比亚迪	19,979	1,592,326.30	1.22
15	300394	天孚通信	4,904	1,484,342.72	1.14
16	301308	江波龙	1,800	1,266,840.00	0.97
17	000651	格力电器	33,748	1,265,550.00	0.97
18	300604	长川科技	3,600	1,229,112.00	0.94

19	000988	华工科技	6,646	1,226,918.06	0.94
20	001309	德明利	1,200	1,131,480.00	0.87
21	000338	潍柴动力	39,624	1,079,754.00	0.83
22	000858	五 粮 液	14,268	1,055,832.00	0.81
23	300124	汇川技术	15,852	1,051,463.16	0.80
24	002415	海康威视	29,011	992,176.20	0.76
25	002281	光迅科技	3,800	976,372.00	0.75
26	002008	大族激光	6,240	936,686.40	0.72
27	000063	中兴通讯	24,983	904,134.77	0.69
28	002916	深南电路	1,972	902,978.80	0.69
29	000100	TCL 科技	150,777	877,522.14	0.67
30	300857	协创数据	2,500	849,750.00	0.65
31	300433	蓝思科技	15,219	816,651.54	0.62
32	002142	宁波银行	26,770	794,801.30	0.61
33	000792	盐湖股份	26,000	784,940.00	0.60
34	300475	香农芯创	2,600	780,000.00	0.60
35	002028	思源电气	4,500	778,500.00	0.60
36	300136	信维通信	6,300	751,275.00	0.57
37	002050	三花智控	16,856	738,798.48	0.57
38	300014	亿纬锂能	11,218	729,506.54	0.56
39	002353	杰瑞股份	4,711	718,427.50	0.55
40	000657	中钨高新	7,300	698,756.00	0.53
41	002156	通富微电	9,200	698,004.00	0.53
42	300223	北京君正	2,800	696,920.00	0.53
43	002714	牧原股份	19,489	681,920.11	0.52
44	300285	国瓷材料	6,600	680,988.00	0.52
45	000001	平安银行	66,421	667,531.05	0.51
46	300760	迈瑞医疗	4,800	651,984.00	0.50
47	002602	世纪华通	45,100	635,910.00	0.49
48	002230	科大讯飞	15,185	620,155.40	0.47
49	002436	兴森科技	11,800	601,210.00	0.46
50	002352	顺丰控股	18,800	587,688.00	0.45
51	002460	赣锋锂业	8,820	576,828.00	0.44
52	300054	鼎龙股份	5,400	572,238.00	0.44
53	000977	浪潮信息	8,011	560,770.00	0.43
54	002709	天赐材料	10,860	558,529.80	0.43
55	000776	广发证券	23,792	556,732.80	0.43
56	300033	同花顺	2,245	541,045.00	0.41

57	000021	深科技	8,400	539,868.00	0.41
58	300498	温氏股份	43,697	538,347.04	0.41
59	002938	鹏鼎控股	5,100	537,438.00	0.41
60	000425	徐工机械	66,298	536,350.82	0.41
61	002851	麦格米特	3,200	534,976.00	0.41
62	300548	长芯博创	1,800	500,400.00	0.38
63	002466	天齐锂业	8,100	496,692.00	0.38
64	300757	罗博特科	800	495,200.00	0.38
65	002409	雅克科技	2,200	493,900.00	0.38
66	002080	中材科技	5,400	486,000.00	0.37
67	000938	紫光股份	16,758	483,635.88	0.37
68	002202	金风科技	20,176	482,206.40	0.37
69	300661	圣邦股份	3,232	463,727.36	0.35
70	002837	英维克	5,800	461,448.00	0.35
71	002185	华天科技	20,577	459,072.87	0.35
72	300395	菲利华	3,400	454,682.00	0.35
73	000568	泸州老窖	5,822	451,321.44	0.35
74	002049	紫光国微	5,085	451,293.75	0.35
75	300442	润泽科技	5,400	448,578.00	0.34
76	002241	歌尔股份	19,790	445,868.70	0.34
77	002600	领益智造	24,900	431,766.00	0.33
78	300390	天华新能	4,500	420,795.00	0.32
79	002179	中航光电	8,926	412,381.20	0.32
80	002407	多氟多	8,200	411,886.00	0.32
81	301526	国际复材	8,700	406,029.00	0.31
82	002138	顺络电子	5,500	402,050.00	0.31
83	000408	藏格矿业	5,700	395,124.00	0.30
84	300058	蓝色光标	28,300	389,408.00	0.30
85	002027	分众传媒	79,188	383,269.92	0.29
86	002625	光启技术	12,600	382,032.00	0.29
87	300620	光库科技	1,000	378,200.00	0.29
88	000630	铜陵有色	59,335	377,370.60	0.29
89	300373	扬杰科技	2,300	361,629.00	0.28
90	000807	云铝股份	16,300	360,882.00	0.28
91	002273	水晶光电	10,100	358,348.00	0.27
92	300037	新宙邦	3,840	356,544.00	0.27
93	300751	迈为股份	1,244	351,380.24	0.27
94	300450	先导智能	8,606	350,436.32	0.27
95	002422	科伦药业	9,016	347,296.32	0.27
96	000426	兴业银锡	10,500	346,080.00	0.26
97	002001	新 和 成	12,124	344,564.08	0.26
98	000960	锡业股份	7,525	321,242.25	0.25
99	002648	卫星化学	13,600	319,464.00	0.24

100	002812	恩捷股份	4,630	309,793.30	0.24
101	000066	中国长城	15,736	299,770.80	0.23
102	000831	中国稀土	5,300	294,097.00	0.23
103	300782	卓胜微	2,678	293,455.24	0.22
104	002738	中矿资源	4,920	290,230.80	0.22
105	300316	晶盛机电	4,800	289,920.00	0.22
106	300015	爱尔眼科	35,090	289,843.40	0.22
107	000166	申万宏源	65,706	289,106.40	0.22
108	001389	广合科技	1,200	284,700.00	0.22
109	000538	云南白药	5,901	279,530.37	0.21
110	300418	昆仑万维	6,900	278,484.00	0.21
111	002129	TCL 中环	23,011	276,592.22	0.21
112	301377	鼎泰高科	500	275,450.00	0.21
113	300803	指南针	2,995	274,551.65	0.21
114	002195	岩山科技	41,200	269,448.00	0.21
115	000625	长安汽车	37,575	269,412.75	0.21
116	002311	海大集团	5,994	267,392.34	0.20
117	000157	中联重科	38,243	266,553.71	0.20
118	301358	湖南裕能	3,500	265,545.00	0.20
119	002850	科达利	1,400	265,020.00	0.20
120	002821	凯莱英	1,620	262,440.00	0.20
121	000933	神火股份	12,300	260,760.00	0.20
122	002558	巨人网络	9,300	256,308.00	0.20
123	002532	天山铝业	23,800	255,374.00	0.20
124	002340	格林美	37,803	249,877.83	0.19
125	002203	海亮股份	10,900	249,065.00	0.19
126	002236	大华股份	14,845	244,794.05	0.19
127	002261	拓维信息	8,400	235,284.00	0.18
128	002074	国轩高科	8,487	233,477.37	0.18
129	000783	长江证券	23,899	233,015.25	0.18
130	002456	欧菲光	24,600	232,716.00	0.18
131	300339	润和软件	6,000	231,060.00	0.18
132	000975	山金国际	13,300	226,100.00	0.17
133	002517	恺英网络	13,800	224,250.00	0.17
134	300759	康龙化成	7,750	224,207.50	0.17
135	300017	网宿科技	17,200	223,772.00	0.17
136	003031	中瓷电子	1,240	223,572.00	0.17
137	002493	荣盛石化	20,550	220,912.50	0.17
138	300458	全志科技	5,580	220,186.80	0.17
139	002736	国信证券	21,775	217,532.25	0.17
140	301611	珂玛科技	1,200	216,084.00	0.17
141	002472	双环传动	5,200	215,852.00	0.17
142	300001	特锐德	5,700	215,631.00	0.16

143	002131	利欧股份	45,300	215,175.00	0.16
144	003816	中国广核	54,700	213,877.00	0.16
145	002555	三七互娱	11,300	213,231.00	0.16
146	002595	豪迈科技	4,565	212,729.00	0.16
147	002966	苏州银行	30,120	209,635.20	0.16
148	000768	中航西飞	10,220	209,305.60	0.16
149	301236	软通动力	4,900	208,005.00	0.16
150	300115	长盈精密	7,400	206,756.00	0.16
151	300207	欣旺达	10,700	203,193.00	0.16
152	002601	龙佰集团	12,300	202,704.00	0.16
153	002056	横店东磁	6,600	201,168.00	0.15
154	002797	第一创业	30,420	199,859.40	0.15
155	300347	泰格医药	4,150	199,200.00	0.15
156	002155	湖南黄金	8,300	198,121.00	0.15
157	000301	东方盛虹	17,200	196,940.00	0.15
158	300454	深信服	2,000	192,400.00	0.15
159	301269	华大九天	1,600	191,072.00	0.15
160	000703	恒逸石化	13,910	188,758.70	0.14
161	002465	海格通信	14,730	188,102.10	0.14
162	002920	德赛西威	2,300	187,450.00	0.14
163	000895	双汇发展	8,318	186,323.20	0.14
164	300024	机器人	9,500	183,635.00	0.14
165	300866	安克创新	1,740	181,830.00	0.14
166	002128	电投能源	7,800	180,336.00	0.14
167	301200	大族数控	500	180,325.00	0.14
168	301536	星宸科技	1,400	180,194.00	0.14
169	000893	亚钾国际	4,400	179,916.00	0.14
170	002487	大金重工	3,100	179,707.00	0.14
171	002304	洋河股份	4,683	178,656.45	0.14
172	000034	神州数码	6,400	177,600.00	0.14
173	002429	兆驰股份	16,900	175,591.00	0.13
174	000733	振华科技	3,100	175,584.00	0.13
175	002414	高德红外	13,145	174,302.70	0.13
176	300496	中科创达	2,800	173,012.00	0.13
177	002271	东方雨虹	14,570	172,945.90	0.13
178	000878	云南铜业	10,823	171,869.24	0.13
179	001979	招商蛇口	26,571	170,851.53	0.13
180	000963	华东医药	5,973	167,960.76	0.13
181	002444	巨星科技	5,400	167,940.00	0.13
182	002025	航天电器	2,200	167,684.00	0.13
183	300748	金力永磁	5,372	165,726.20	0.13
184	002157	正邦科技	58,800	165,228.00	0.13
185	300474	景嘉微	2,700	163,296.00	0.12

186	002252	上海莱士	37,413	162,372.42	0.12
187	000661	长春高新	2,390	159,174.00	0.12
188	000423	东阿阿胶	3,500	158,760.00	0.12
189	002756	永兴材料	2,770	156,892.80	0.12
190	000728	国元证券	20,848	156,151.52	0.12
191	000002	万　科Ａ	52,698	155,986.08	0.12
192	002078	太阳纸业	12,400	154,876.00	0.12
193	300073	当升科技	3,200	153,728.00	0.12
194	300763	锦浪科技	1,700	153,595.00	0.12
195	002130	沃尔核材	8,100	153,576.00	0.12
196	300012	华测检测	11,000	152,460.00	0.12
197	300724	捷佳伟创	2,100	148,260.00	0.11
198	002653	海思科	2,200	145,948.00	0.11
199	002831	裕同科技	4,030	143,306.80	0.11
200	300919	中伟新材	3,260	142,625.00	0.11
201	300383	光环新网	11,200	139,328.00	0.11
202	000519	中兵红箭	6,600	139,062.00	0.11
203	000786	北新建材	7,638	138,171.42	0.11
204	002624	完美世界	10,900	135,378.00	0.10
205	000617	中油资本	20,500	135,095.00	0.10
206	001965	招商公路	14,700	134,652.00	0.10
207	302132	中航成飞	2,200	128,304.00	0.10
208	002064	华峰化学	13,400	127,166.00	0.10
209	300628	亿联网络	3,760	127,163.20	0.10
210	000559	万向钱潮	9,800	126,714.00	0.10
211	002673	西部证券	19,302	125,269.98	0.10
212	000623	吉林敖东	7,061	125,191.53	0.10
213	002180	奔图科技	7,600	124,336.00	0.10
214	002044	美年健康	24,628	123,878.84	0.09
215	300251	光线传媒	11,006	122,056.54	0.09
216	300255	常山药业	5,200	121,784.00	0.09
217	300972	万辰集团	700	121,387.00	0.09
218	002294	信立泰	3,802	121,245.78	0.09
219	002065	东华软件	16,960	121,094.40	0.09
220	300699	光威复材	4,220	120,903.00	0.09
221	000958	电投产融	21,400	120,696.00	0.09
222	300487	蓝晓科技	2,050	120,642.50	0.09
223	000750	国海证券	32,649	120,148.32	0.09
224	001203	大中矿业	4,000	119,800.00	0.09
225	000032	深桑达Ａ	4,800	119,760.00	0.09
226	002223	鱼跃医疗	4,626	118,703.16	0.09
227	001696	宗申动力	5,700	118,617.00	0.09
228	000683	博源化工	20,500	118,080.00	0.09

229	300832	新产业	2,800	117,600.00	0.09
230	002739	儒意电影	12,100	116,160.00	0.09
231	002085	万丰奥威	10,400	115,336.00	0.09
232	002318	久立特材	4,800	114,720.00	0.09
233	000887	中鼎股份	6,400	114,496.00	0.09
234	002459	晶澳科技	14,124	114,404.40	0.09
235	000983	山西焦煤	19,701	114,265.80	0.09
236	000629	钒钛股份	33,700	112,558.00	0.09
237	002405	四维图新	17,291	111,872.77	0.09
238	000999	华润三九	4,959	111,527.91	0.09
239	000400	许继电气	5,100	110,670.00	0.08
240	300003	乐普医疗	9,306	110,276.10	0.08
241	000050	深天马A	11,103	110,030.73	0.08
242	000155	川能动力	9,100	109,018.00	0.08
243	002266	浙富控股	21,300	107,778.00	0.08
244	000876	新 希 望	16,606	104,119.62	0.08
245	300122	智飞生物	8,800	102,872.00	0.08
246	002683	广东宏大	3,500	102,515.00	0.08
247	300999	金龙鱼	4,400	102,344.00	0.08
248	002841	视源股份	2,900	100,137.00	0.08
249	002430	杭氧股份	3,200	99,072.00	0.08
250	000738	航发控制	5,348	97,814.92	0.07
251	002007	华兰生物	7,977	97,239.63	0.07
252	300896	爱美客	1,100	95,920.00	0.07
253	000729	燕京啤酒	9,376	94,978.88	0.07
254	000830	鲁西化工	7,900	94,800.00	0.07
255	002152	广电运通	10,060	94,362.80	0.07
256	002926	华西证券	11,500	93,955.00	0.07
257	000997	新 大 陆	5,700	92,910.00	0.07
258	000528	柳工	12,200	92,110.00	0.07
259	002603	以岭药业	6,080	91,200.00	0.07
260	301165	锐捷网络	1,104	88,816.80	0.07
261	000932	华菱钢铁	25,580	88,762.60	0.07
262	000596	古井贡酒	1,100	87,780.00	0.07
263	001280	中国铀业	1,300	86,710.00	0.07
264	002939	长城证券	10,300	85,902.00	0.07
265	000987	越秀资本	10,743	84,010.26	0.06
266	000708	中信特钢	6,600	83,292.00	0.06
267	000921	海信家电	3,000	81,960.00	0.06
268	000009	中国宝安	13,032	81,189.36	0.06
269	300765	石药创新	2,900	78,967.00	0.06
270	002262	恩华药业	4,200	78,750.00	0.06
271	002312	川发龙蟒	8,500	77,945.00	0.06

272	000723	美锦能源	22,400	75,040.00	0.06
273	002244	滨江集团	9,700	73,720.00	0.06
274	003022	联泓新科	2,800	72,520.00	0.06
275	002299	圣农发展	4,699	71,236.84	0.05
276	300413	芒果超媒	4,860	71,101.80	0.05
277	000027	深圳能源	9,663	59,910.60	0.05
278	000883	湖北能源	13,443	58,073.76	0.04
279	000825	太钢不锈	16,965	57,850.65	0.04
280	002423	中粮资本	7,000	57,610.00	0.04
281	000709	河钢股份	29,600	57,424.00	0.04
282	001286	陕西能源	5,600	56,784.00	0.04
283	000800	一汽解放	8,800	52,360.00	0.04
284	002670	国盛证券	4,700	51,700.00	0.04
285	002773	康弘药业	2,500	51,125.00	0.04
286	001391	国货航	11,700	47,619.00	0.04
287	002153	石基信息	6,310	45,621.30	0.03
288	000539	粤电力Ａ	6,600	44,946.00	0.03
289	300979	华利集团	1,500	44,625.00	0.03
290	002032	苏 泊 尔	1,100	43,560.00	0.03
291	301301	川宁生物	5,000	39,700.00	0.03
292	000877	天山股份	10,900	39,567.00	0.03
293	002608	江苏国信	5,400	37,260.00	0.03
294	000959	首钢股份	10,200	35,802.00	0.03
295	001872	招商港口	1,700	33,031.00	0.03
296	002265	建设工业	1,800	31,320.00	0.02
297	002945	华林证券	2,200	29,546.00	0.02
298	301656	联合动力	1,700	29,291.00	0.02
299	301498	乖宝宠物	700	28,413.00	0.02
300	001289	龙源电力	1,100	17,193.00	0.01

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	001309	德明利	837,032.00	0.59
2	002602	世纪华通	695,714.00	0.49

3	300136	信维通信	655,877.00	0.47
4	300757	罗博特科	549,413.00	0.39
5	300475	香农芯创	532,574.00	0.38
6	300390	天华新能	458,619.00	0.33
7	301308	江波龙	449,618.00	0.32
8	300548	长芯博创	427,958.00	0.30
9	300058	蓝色光标	425,594.00	0.30
10	002837	英维克	416,939.00	0.30
11	002407	多氟多	334,538.00	0.24
12	300620	光库科技	318,616.00	0.23
13	301526	国际复材	261,147.00	0.19
14	301377	鼎泰高科	235,468.00	0.17
15	001389	广合科技	233,852.00	0.17
16	002487	大金重工	190,780.00	0.14
17	001203	大中矿业	181,022.00	0.13
18	002384	东山精密	170,654.00	0.12
19	300751	迈为股份	150,717.00	0.11
20	301611	珂玛科技	142,196.00	0.10

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	350,567.00	0.25
2	300308	中际旭创	346,482.00	0.25
3	300502	新易盛	343,309.00	0.24
4	000333	美的集团	197,599.00	0.14
5	002371	北方华创	178,104.00	0.13
6	300142	沃森生物	163,307.00	0.12
7	002475	立讯精密	147,275.00	0.10
8	002384	东山精密	142,381.00	0.10
9	300274	阳光电源	139,081.00	0.10
10	300476	胜宏科技	124,427.00	0.09
11	300394	天孚通信	122,214.00	0.09
12	300059	东方财富	121,733.00	0.09
13	002594	比亚迪	118,144.00	0.08
14	300558	贝达药业	115,368.00	0.08
15	000725	京东方 A	108,712.00	0.08
16	002410	广联达	107,584.30	0.08
17	000858	五 粮 液	104,316.00	0.07

18	000513	丽珠集团	103,940.55	0.07
19	300408	三环集团	102,073.00	0.07
20	002568	百润股份	90,140.00	0.06

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	11,144,271.00
卖出股票收入（成交）总额	9,655,656.12

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:本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，立讯精密工业股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决

策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

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	647.28
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	647.28

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

			（%）		（%）		（%）
2,015	29,006.94	46,278,925.00	79.18	12,170,066.00	20.82	42,292,042.00	72.36

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。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 09 月 16 日）基金份额总额	521,548,991.00
本报告期期初基金份额总额	75,948,991.00
本报告期基金总申购份额	17,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	35,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	58,448,991.00

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，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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（%）	
国泰海通	6	17,368,113.12	83.50	3,055.20	83.50	
兴业证券	3	1,934,275.00	9.30	340.28	9.30	
平安证券	3	794,775.0	3.82	139.78	3.82	

		0				
中信证券	4	702,764.00	3.38	123.63	3.38	
财通证券	2	-	-	-	-	
长城证券	2	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	
东北证券	2	-	-	-	-	
东方证券	6	-	-	-	-	
东吴证券	1	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国海证券	2	-	-	-	-	
国联民生	2	-	-	-	-	
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	-	-	-	-	
瑞银证券	2	-	-	-	-	
申万宏源证券	3	-	-	-	-	
信达证券	1	-	-	-	-	
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	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 基金租用或者通过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（%）

国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加世纪证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 01 月 12 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗	中国证监会基金电子	2026 年 01 月 22 日

	下基金 2025 年第四季度报告	披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加万和证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站,上交所,深交所,公司网站,上证报	2026 年 03 月 16 日
4	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（2025 年度）	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 03 月 31 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 03 月 31 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 04 月 22 日
7	2025 年度汇添富基金管理股份有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站	2026 年 04 月 30 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源证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 06 月 03 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 06 月 06 日
10	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	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,证券时报	2026 年 06 月 29 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		份额比例达到或者超过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	2026年1月1日至2026年6月30日	50,185,842.00	7,092,300.00	14,986,100.00	42,292,042.00	72.36
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

2026 年 08 月 31 日