

深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 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	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
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	19
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	20
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	20
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	20
6.1 资产负债表	20
6.2 利润表	21
6.3 净资产（基金净值）变动表	22
6.4 报表附注	24
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
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	47
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	56
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.....	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
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.....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§ 12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 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）	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		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		李文	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路 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(2023 年 01 月 01 日 - 2023 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	-236,652.09
本期利润	-264,539.87
加权平均基金份额本期利润	-0.0045
本期加权平均净值利润率	-0.29%
本期基金份额净值增长率	-0.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	28,331,174.09
期末可供分配基金份额利润	0.4847
期末基金资产净值	86,780,165.09
期末基金份额净值	1.4847
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	48.47%

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	3.12%	1.08%	2.60%	1.08%	0.52%	0.00%
过去三个月	-5.45%	0.91%	-6.19%	0.91%	0.74%	0.00%
过去六个月	-0.30%	0.91%	-0.93%	0.92%	0.63%	-0.01%
过去一年	-15.31%	1.07%	-15.93%	1.08%	0.62%	-0.01%
过去三年	-7.67%	1.34%	-9.08%	1.35%	1.41%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	48.47%	1.53%	37.71%	1.55%	10.76%	-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

汇添富深证300ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011年09月16日）起3个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于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。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。

2023 上半年，汇添富基金新成立 27 只公开募集证券投资基金，包括 10 只股票型基金、9 只混合型基金、8 只债券型基金。截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 297 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
晏阳	本基金的基金经理	2023 年 05 月 22 日		7	国籍：中国。学历：哥伦比亚大学统计学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2016 年 9 月至 2021 年 8 月任中证指数有限公司研究员、高级研究员。2021 年 9 月加入汇添富基金管理股份有限公司，担任指数与量化投资部基金经理。2022 年 7 月 13 日至今任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至今任汇添富中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 27 日至今任汇添富

				<p>北证 50 成份指数型证券投资基金的基金经理。2023 年 1 月 16 日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月 14 日至今任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 5 月 22 日至今任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 22 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 24 日至今任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基</p>
--	--	--	--	---

					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。
赖中立	本基金的基金经理	2015 年 01 月 06 日	2023 年 04 月 13 日	16	国籍：中国。学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012 年 11 月 1 日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2014 年 3 月 6 日至 2023 年 4 月 13 日任汇添富恒生指数型证券投资基金 (QDII-LOF) 的基金经理。2015 年 1 月 6 日至 2023 年 4 月 13 日任

				<p>深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月 26 日至 2016 年 7 月 13 日任汇添富香港优势精选混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2023 年 4 月 13 日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 5 月 18 日至今任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 11 月 24 日至 2023 年 4 月 13 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。2021 年 10 月 26 日至今任汇添富中证沪港深消费龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 26 日至今任汇添富中证光伏产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 29 日至今任汇添富中证科创创业</p>
--	--	--	--	---

					50 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月 5 日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。
过蓓蓓	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2015 年 08 月 18 日	2023 年 05 月 22 日	12	国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部副总监。2015 年 8 月 3 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 13 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 6 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基

				<p>金的基金经理。 2015 年 8 月 3 日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至今任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至 2023 年 5 月 22 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2022 年 12 月 1 日任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

				<p>2018 年 10 月 23 日至 2023 年 5 月 22 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月 26 日至今任汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 4 月 15 日至 2022 年 6 月 13 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月 3 日至今任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至 2023 年 5 月 18 日任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 2 月 28 日至</p>
--	--	--	--	--

				<p>2022 年 10 月 31 日任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2022 年 8 月 15 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。</p> <p>2022 年 9 月 26 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 10 月 20 日至今任汇添富中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 12 月 2 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2023 年 3 月 14 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。</p> <p>2023 年 3 月 30 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）</p>
--	--	--	--	--

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 25 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。

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

2023 年上半年，我国经济整体呈现复苏态势。初步核算，上半年国内生产总值约 59.3 万亿元，按不变价格计算同比增长 5.5%。生产方面，上半年全国规模以上工业增加值同比增长 3.8%，增幅较 1-5 月提高 0.2 个百分点，工业企业生产复苏态势良好；投资方面，上半年全国固定资产投资 24.31 万亿元，同比增长 3.8%，其中主要依托于基础设施投资和制造业投资，两者同比增长分别为 7.2% 和 6.0%，而房地产开发投资同比下降 7.9%；消费方面，上半年社会消费品零售总额 22.76 万亿元，同比增长 8.2%。

权益市场方面，2023 上半年 A 股整体震荡。市场主要表征指数中上证综指表现相对较好，半年度涨幅 3.65%。行业方面，通信、传媒、计算机、机械设备和家用电器表现靠前，而商贸零售、房地产、美容护理、建筑材料等表现靠后。风格方面，以中证 1000 为代表的小盘强于以沪深 300 为代表的大盘，但价值风格强于成长风格。总体而言，“中特估”与“数字经济”是上半年相对明确的主线。节奏上看，经济复苏的波动是影响市场表现的重要原因，年初较好的复苏预期带动市场显著回暖，二季度复苏预期转弱导致市场回调。

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

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-0.30%。同期业绩比较基准收益率为-0.93%。

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，中国经济或将企稳回升。固定资产投资、社会消费品零售总额、工业增加值的环比增速在 4 月均弱于历史同期均值，到 6 月已呈现超季节性走高。具体而言，生产方面采矿业、制造业和“电气水”三大门类的工业增加值 6 月环比均已出现改善；投资

方面基建与制造业投资有望维持韧性，促进房地产健康发展的政策亦有望显效；消费方面，下半年的消费旺季或将带来较大提振，叠加后续汽车销售等政策支持，预计下半年消费仍将维持较高增速。

权益市场方面，A 股市场有望随着经济复苏步入上行区间。经历二季度市场回调后，当前股权风险溢价已处于相对较高水平，权益资产已具备较高性价比。行业主题上，“中特估”与“数字经济”有望延续成为全年主线。风格上，价值与成长可适当均衡配置。深证 300 指数涵盖众多优质成长型企业，具有良好的投资价值。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例依据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2023 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：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	459,244.07	927,621.21
结算备付金		1,103.27	-
存出保证金		325.79	277.29
交易性金融资产	6.4.7.2	86,501,298.55	86,315,800.48
其中：股票投资		86,501,298.55	86,315,800.48
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		86,961,971.68	87,243,698.98
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		35,410.39	36,245.02
应付托管费		7,082.06	7,249.00
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	139,314.14	155,500.00
负债合计		181,806.59	198,994.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	58,448,991.00	58,448,991.00
未分配利润	6.4.7.9	28,331,174.09	28,595,713.96
净资产合计		86,780,165.09	87,044,704.96
负债和净资产总计		86,961,971.68	87,243,698.98

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4847 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30	2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30

		日	日
一、营业总收入		133,352.19	-11,177,787.13
1. 利息收入		1,289.65	1,559.33
其中：存款利息收入	6.4.7.10	1,289.65	1,559.33
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		159,950.32	11,342.13
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-723,048.76	-723,339.09
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	7,241.04
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	882,999.08	727,440.18
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	-27,887.78	-11,191,026.59
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	-	338.00
减：二、营业总支出		397,892.06	386,396.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	223,225.65	213,817.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	44,645.07	42,763.58
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.21	130,021.34	129,815.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-264,539.87	-11,564,183.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-264,539.87	-11,564,183.94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-264,539.87	-11,564,183.94

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：深证 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	58,448,991.00	28,595,713.96	87,044,704.96
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	58,448,991.00	28,595,713.96	87,044,704.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-264,539.87	-264,539.87
（一）、综合收益总额	-	-264,539.87	-264,539.87
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	58,448,991.00	28,331,174.09	86,780,165.09
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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（基金净值）	47,948,991.00	48,090,757.16	96,039,748.16
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	47,948,991.00	48,090,757.16	96,039,748.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,800,000.00	-8,367,693.32	-3,567,693.32
（一）、综合收益总额	-	-11,564,183.94	-11,564,183.94
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	4,800,000.00	3,196,490.62	7,996,490.62
其中：1. 基金申购款	6,400,000.00	4,206,538.19	10,606,538.19
2. 基金赎回款	-1,600,000.00	-1,010,047.57	-2,610,047.57
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	52,748,991.00	39,723,063.84	92,472,054.84

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。基金合同于2011年9月16日生效。首次设立基金募集规模为521,548,991.00份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2011）验字第60466941_B08号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金的业绩比较基准为：深证300指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2023年06月30日的财务状况以及2023年01月01日至2023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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，

其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	459,244.07
等于：本金	459,206.79
加：应计利息	37.28
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	459,244.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	85,450,304.81	-	86,501,298.55	1,050,993.74
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	85,450,304.81	-	86,501,298.55	1,050,993.74

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：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内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 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,058.80
其中：交易所市场	4,058.80
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	60,583.76
应付信息披露费	39,671.58
应付指数使用费	35,000.00
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-

应付持有人大会费-律师费	
其他	
合计	139,314.14

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,448,991.00	58,448,991.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	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
本期期初	52,977,417.86	-24,381,703.90	28,595,713.96
本期利润	-236,652.09	-27,887.78	-264,539.87
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,740,765.77	-24,409,591.68	28,331,174.09

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	1,247.33
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	39.75

其他	2.57
合计	1,289.65

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	2,819,517.69
减：卖出股票成本总额	3,534,991.79
减：交易费用	7,574.66
买卖股票差价收入	-723,048.76

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	882,999.08
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	882,999.08

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-27,887.78
——股票投资	-27,887.78
——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	-27,887.78

6.4.7.19 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	20,083.76
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	66.00
指数使用费	70,000.00
持有人大会-公证费	-

持有人大会-律师费	-
开户费	200.00
上市费	-
其他	-
合计	130,021.34

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	6,183,954.85	100.00	11,435,718.58	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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	-	-	49,442.23	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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣 金总额的比例 (%)
东方证券	4,460.57	100.00	4,058.80	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	8,227.68	100.00	6,766.69	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	223,225.65	213,817.89
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	44,645.07	42,763.58

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 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	36,914,142.00	63.16	36,914,142.00	63.16

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	459,244.07	1,247.33	700,360.42	1,453.70

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（2023 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 2023 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 2023 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 2023 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 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个 月- 1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	459,244.07	-	-	-	-	-	459,244.07
结算备付金	1,103.27	-	-	-	-	-	1,103.27
存出保证金	325.79	-	-	-	-	-	325.79
交易性金融资产	-	-	-	-	-	86,501,298.55	86,501,298.55
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	460,673.13	-	-	-	-	86,501,298.55	86,961,971.68
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	-	-	-	-	-	35,410.39	35,410.39
应付托管费	-	-	-	-	-	7,082.06	7,082.06
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	-	-	-	-	-	139,314.14	139,314.14
负债总计	-	-	-	-	-	181,806.59	181,806.59
利率敏感度缺口	460,673.13	-	-	-	-	86,319,491.96	86,780,165.09
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	927,621.21	-	-	-	-	-	927,621.21
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	277.29	-	-	-	-	-	277.29
交易性金融资产	-	-	-	-	-	86,315,800.48	86,315,800.48
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	927,898.50	-	-	-	-	86,315,800.48	87,243,698.98
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	-	-	-	-	-	36,245.02	36,245.02

人报 酬							
应付 托管 费	-	-	-	-	-	7,249.00	7,249.00
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	-	-	-	-	-	155,500.00	155,500.00
负债 总计	-	-	-	-	-	198,994.02	198,994.02
利率 敏感 度缺 口	927,898.50	-	-	-	-	86,116,806.46	87,044,704.96

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 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	86,501,298.55	99.68	86,315,800.48	99.16
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	86,501,298.55	99.68	86,315,800.48	99.16

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	深证 300 指数 上涨 5%	4,310,000.11	4,323,595.38
	深证 300 指数 下跌 5%	-4,310,000.11	-4,323,595.38

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 2023 年 06 月 30 日
第一层次	86,501,298.55
第二层次	-
第三层次	-
合计	86,501,298.55

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，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	86,501,298.55	99.47
	其中：股票	86,501,298.55	99.47
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	460,347.34	0.53
8	其他各项资产	325.79	0.00
9	合计	86,961,971.68	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	2,052,103.95	2.36
B	采矿业	793,417.10	0.91
C	制造业	65,570,093.83	75.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	678,509.25	0.78
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	309,117.01	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	1,175,020.96	1.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,722,672.70	5.44
J	金融业	6,134,319.06	7.07
K	房地产业	1,384,152.49	1.60
L	租赁和商务服务业	682,898.28	0.79
M	科学研究和技术服务业	944,904.00	1.09
N	水利、环境和公共设施管理业	169,588.56	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	152,750.00	0.18
Q	卫生和社会工作	974,015.58	1.12
R	文化、体育和娱乐业	584,748.54	0.67
S	综合	172,987.24	0.20
	合计	86,501,298.55	99.68

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票组合。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	22,380	5,120,320.20	5.90
2	000858	五粮液	16,268	2,660,956.76	3.07
3	000333	美的集团	43,784	2,579,753.28	2.97
4	002594	比亚迪	7,693	1,986,871.11	2.29
5	300059	东方财富	111,384	1,581,652.80	1.82
6	000651	格力电器	39,948	1,458,501.48	1.68
7	000568	泸州老窖	6,622	1,387,772.54	1.60
8	002475	立讯精密	40,788	1,323,570.60	1.53
9	300760	迈瑞医疗	4,400	1,319,120.00	1.52
10	000063	中兴通讯	28,083	1,278,899.82	1.47
11	000725	京东方A	285,808	1,168,954.72	1.35
12	002415	海康威视	34,011	1,126,104.21	1.30
13	300124	汇川技术	17,052	1,094,908.92	1.26
14	002230	科大讯飞	15,785	1,072,748.60	1.24
15	300274	阳光电源	9,000	1,049,670.00	1.21
16	002352	顺丰控股	21,100	951,399.00	1.10
17	002714	牧原股份	22,189	935,266.35	1.08
18	002129	TCL中环	26,411	876,845.20	1.01
19	300498	温氏股份	47,597	873,404.95	1.01
20	000001	平安银行	75,821	851,469.83	0.98
21	002142	宁波银行	31,670	801,251.00	0.92
22	300308	中际旭创	5,380	793,281.00	0.91
23	000002	万科A	54,998	771,071.96	0.89
24	002371	北方华创	2,400	762,360.00	0.88
25	002304	洋河股份	5,383	707,057.05	0.81
26	300015	爱尔眼科	36,690	680,599.50	0.78
27	300014	亿纬锂能	11,218	678,689.00	0.78

28	000792	盐湖股份	34,700	665,199.00	0.77
29	002466	天齐锂业	9,200	643,172.00	0.74
30	002027	分众传媒	90,488	616,223.28	0.71
31	002460	赣锋锂业	10,020	610,819.20	0.70
32	002459	晶澳科技	14,024	584,800.80	0.67
33	000338	潍柴动力	46,124	574,705.04	0.66
34	002049	紫光国微	5,885	548,776.25	0.63
35	000100	TCL 科技	134,477	529,839.38	0.61
36	002050	三花智控	16,756	507,036.56	0.58
37	000938	紫光股份	15,558	495,522.30	0.57
38	000625	长安汽车	37,575	485,844.75	0.56
39	002271	东方雨虹	17,170	468,054.20	0.54
40	002555	三七互娱	13,400	467,392.00	0.54
41	002179	中航光电	9,866	447,423.10	0.52
42	002709	天赐材料	10,760	443,204.40	0.51
43	300122	智飞生物	9,900	437,580.00	0.50
44	002812	恩捷股份	4,530	436,465.50	0.50
45	000977	浪潮信息	8,711	422,483.50	0.49
46	002241	歌尔股份	21,990	390,322.50	0.45
47	300316	晶盛机电	5,500	389,950.00	0.45
48	300142	沃森生物	14,600	386,170.00	0.44
49	002410	广联达	11,594	376,689.06	0.43
50	000776	广发证券	25,392	373,516.32	0.43
51	000661	长春高新	2,690	366,647.00	0.42
52	000166	申万宏源	79,106	365,469.72	0.42
53	002602	世纪华通	47,576	361,101.84	0.42
54	300896	爱美客	800	355,960.00	0.41
55	001979	招商蛇口	25,271	329,281.13	0.38
56	002311	海大集团	6,994	327,598.96	0.38
57	002920	德赛西威	2,100	327,201.00	0.38
58	300408	三环集团	11,100	325,785.00	0.38
59	300450	先导智能	8,906	322,130.02	0.37
60	000596	古井贡酒	1,300	321,594.00	0.37
61	002252	上海莱士	42,813	321,525.63	0.37
62	000733	振华科技	3,300	316,305.00	0.36
63	002493	荣盛石化	27,150	316,026.00	0.36
64	000538	云南白药	6,001	314,932.48	0.36
65	300347	泰格医药	4,850	313,019.00	0.36
66	000768	中航西飞	11,620	310,835.00	0.36
67	002236	大华股份	15,645	308,988.75	0.36
68	300033	同花顺	1,732	303,584.96	0.35
69	300496	中科创达	3,100	298,685.00	0.34
70	002340	格林美	43,203	298,532.73	0.34

71	000425	徐工机械	43,898	297,189.46	0.34
72	002384	东山精密	11,350	293,965.00	0.34
73	000963	华东医药	6,773	293,745.01	0.34
74	300782	卓胜微	2,978	287,764.14	0.33
75	000988	华工科技	7,446	283,022.46	0.33
76	002180	纳思达	8,100	277,425.00	0.32
77	300418	昆仑万维	6,800	273,904.00	0.32
78	000157	中联重科	40,143	270,965.25	0.31
79	002422	科伦药业	9,116	270,562.88	0.31
80	002074	国轩高科	9,287	256,506.94	0.30
81	002202	金风科技	23,676	251,439.12	0.29
82	300003	乐普医疗	11,006	248,845.66	0.29
83	000066	中国长城	17,936	248,054.88	0.29
84	002463	沪电股份	11,830	247,720.20	0.29
85	300724	捷佳伟创	2,200	247,170.00	0.28
86	300012	华测检测	12,500	243,750.00	0.28
87	002738	中矿资源	4,720	240,436.80	0.28
88	000807	云铝股份	18,700	238,051.00	0.27
89	300454	深信服	2,100	237,825.00	0.27
90	002028	思源电气	5,000	233,600.00	0.27
91	000895	双汇发展	9,518	233,095.82	0.27
92	300223	北京君正	2,600	229,606.00	0.26
93	300751	迈为股份	1,344	227,646.72	0.26
94	002405	四维图新	19,591	226,863.78	0.26
95	002821	凯莱英	1,920	226,291.20	0.26
96	002601	龙佰集团	13,500	222,750.00	0.26
97	000876	新希望	19,006	221,990.08	0.26
98	300037	新宙邦	4,240	220,013.60	0.25
99	000301	东方盛虹	18,600	219,852.00	0.25
100	000423	东阿阿胶	4,100	219,145.00	0.25
101	002001	新和成	14,224	219,049.60	0.25
102	300661	圣邦股份	2,648	217,480.24	0.25
103	002156	通富微电	9,500	214,700.00	0.25
104	002736	国信证券	24,575	214,539.75	0.25
105	002472	双环传动	5,900	214,170.00	0.25
106	002185	华天科技	23,277	214,148.40	0.25
107	300146	汤臣倍健	8,888	213,134.24	0.25
108	002558	巨人网络	11,600	207,988.00	0.24
109	002841	视源股份	3,100	207,204.00	0.24
110	300769	德方纳米	1,860	205,027.80	0.24
111	300433	蓝思科技	17,319	203,671.44	0.23
112	002007	华兰生物	9,077	203,415.57	0.23
113	000999	华润三九	3,312	200,905.92	0.23

114	300207	欣旺达	12,300	200,736.00	0.23
115	300999	金龙鱼	5,000	199,950.00	0.23
116	000786	北新建材	8,144	199,609.44	0.23
117	300759	康龙化成	5,100	195,228.00	0.22
118	002797	第一创业	34,120	195,166.40	0.22
119	003816	中国广核	62,600	194,686.00	0.22
120	002008	大族激光	7,340	192,308.00	0.22
121	000975	银泰黄金	16,400	191,880.00	0.22
122	300285	国瓷材料	7,000	191,800.00	0.22
123	002223	鱼跃医疗	5,326	191,682.74	0.22
124	002624	完美世界	11,300	190,857.00	0.22
125	300413	芒果超媒	5,560	190,207.60	0.22
126	000799	酒鬼酒	2,100	189,315.00	0.22
127	002625	光启技术	12,400	189,224.00	0.22
128	002385	大北农	28,587	188,674.20	0.22
129	300763	锦浪科技	1,800	187,380.00	0.22
130	002044	美年健康	26,128	185,770.08	0.21
131	000783	长江证券	31,799	184,434.20	0.21
132	002966	苏州银行	28,070	183,858.50	0.21
133	002409	雅克科技	2,500	182,200.00	0.21
134	002439	启明星辰	6,120	182,131.20	0.21
135	300395	菲利华	3,700	182,040.00	0.21
136	300073	当升科技	3,600	181,188.00	0.21
137	300474	景嘉微	2,000	179,980.00	0.21
138	000630	铜陵有色	62,135	179,570.15	0.21
139	002603	以岭药业	6,980	179,316.20	0.21
140	300568	星源材质	10,291	176,902.29	0.20
141	002600	领益智造	25,200	174,132.00	0.20
142	002756	永兴材料	2,770	173,429.70	0.20
143	000009	中国宝安	14,332	172,987.24	0.20
144	000932	华菱钢铁	36,080	172,101.60	0.20
145	000021	深科技	8,600	171,914.00	0.20
146	002568	百润股份	4,724	171,717.40	0.20
147	300253	卫宁健康	15,741	170,317.62	0.20
148	000723	美锦能源	22,200	167,388.00	0.19
149	002407	多氟多	8,400	166,824.00	0.19
150	000683	远兴能源	23,100	166,089.00	0.19
151	300390	天华新能	4,580	163,964.00	0.19
152	002497	雅化集团	9,200	163,576.00	0.19
153	000831	中国稀土	5,500	162,800.00	0.19
154	300919	中伟股份	2,700	162,675.00	0.19
155	300144	宋城演艺	13,076	162,142.40	0.19
156	002176	江特电机	13,600	162,112.00	0.19

157	000591	太阳能	23,700	160,686.00	0.19
158	002025	航天电器	2,500	159,500.00	0.18
159	300832	新产业	2,700	159,300.00	0.18
160	002850	科达利	1,200	158,700.00	0.18
161	002465	海格通信	15,330	158,512.20	0.18
162	000983	山西焦煤	17,401	158,349.10	0.18
163	000617	中油资本	21,700	156,891.00	0.18
164	000728	国元证券	23,848	155,488.96	0.18
165	002607	中公教育	32,500	152,750.00	0.18
166	002865	钧达股份	1,000	152,530.00	0.18
167	000738	航发控制	6,148	150,011.20	0.17
168	000069	华侨城A	33,981	149,516.40	0.17
169	300118	东方日升	5,800	148,654.00	0.17
170	002078	太阳纸业	13,900	148,591.00	0.17
171	300604	长川科技	3,100	147,219.00	0.17
172	000860	顺鑫农业	4,350	146,551.50	0.17
173	300699	光威复材	4,720	145,612.00	0.17
174	002262	恩华药业	4,700	144,901.00	0.17
175	300628	亿联网络	4,060	142,384.20	0.16
176	000408	藏格矿业	6,300	142,191.00	0.16
177	000998	隆平高科	9,248	141,956.80	0.16
178	300777	中简科技	3,000	141,780.00	0.16
179	002138	顺络电子	5,900	141,069.00	0.16
180	002430	杭氧股份	4,100	140,876.00	0.16
181	000878	云南铜业	12,723	140,589.15	0.16
182	300487	蓝晓科技	2,250	140,445.00	0.16
183	002673	西部证券	22,102	140,347.70	0.16
184	002444	巨星科技	6,400	140,032.00	0.16
185	300601	康泰生物	5,480	139,137.20	0.16
186	000519	中兵红箭	7,500	135,675.00	0.16
187	002152	广电运通	11,560	135,483.20	0.16
188	300438	鹏辉能源	2,800	134,512.00	0.16
189	000513	丽珠集团	3,443	133,967.13	0.15
190	002353	杰瑞股份	5,311	133,465.43	0.15
191	300595	欧普康视	4,420	133,439.80	0.15
192	002065	东华软件	18,860	133,151.60	0.15
193	000729	燕京啤酒	10,676	133,129.72	0.15
194	000960	锡业股份	8,525	132,563.75	0.15
195	300383	光环新网	12,300	132,225.00	0.15
196	002938	鹏鼎控股	5,400	131,166.00	0.15
197	002056	横店东磁	7,200	131,112.00	0.15
198	002294	信立泰	4,202	131,060.38	0.15
199	002739	万达电影	10,400	130,416.00	0.15

200	000629	钒钛股份	33,000	129,030.00	0.15
201	002080	中材科技	6,200	127,224.00	0.15
202	002595	豪迈科技	3,600	126,468.00	0.15
203	300676	华大基因	2,100	125,979.00	0.15
204	000623	吉林敖东	7,761	124,486.44	0.14
205	002507	涪陵榨菜	6,760	123,775.60	0.14
206	002916	深南电路	1,640	123,606.80	0.14
207	002531	天顺风能	8,100	123,363.00	0.14
208	300001	特锐德	5,900	122,602.00	0.14
209	300866	安克创新	1,400	122,500.00	0.14
210	000708	中信特钢	7,600	120,384.00	0.14
211	002192	融捷股份	1,800	120,294.00	0.14
212	000703	恒逸石化	17,710	120,073.80	0.14
213	002203	海亮股份	9,900	118,899.00	0.14
214	002683	广东宏大	4,000	117,760.00	0.14
215	000547	航天发展	11,733	117,330.00	0.14
216	002120	韵达股份	11,966	114,394.96	0.13
217	300682	朗新科技	4,900	114,072.00	0.13
218	002506	协鑫集成	38,500	112,805.00	0.13
219	000762	西藏矿业	3,800	112,594.00	0.13
220	002414	高德红外	14,445	112,237.65	0.13
221	002557	洽洽食品	2,700	112,185.00	0.13
222	002372	伟星新材	5,400	110,916.00	0.13
223	300558	贝达药业	2,300	110,469.00	0.13
224	002532	天山铝业	18,400	110,216.00	0.13
225	002926	华西证券	13,000	108,030.00	0.12
226	000893	亚钾国际	4,700	107,818.00	0.12
227	300244	迪安诊断	4,200	107,646.00	0.12
228	002064	华峰化学	15,500	106,330.00	0.12
229	300373	扬杰科技	2,600	105,482.00	0.12
230	000750	国海证券	31,449	105,354.15	0.12
231	000155	川能动力	7,200	103,680.00	0.12
232	002508	老板电器	4,090	103,436.10	0.12
233	300748	金力永磁	3,420	102,326.40	0.12
234	300251	光线传媒	12,606	101,982.54	0.12
235	000877	天山股份	12,500	101,750.00	0.12
236	002299	圣农发展	5,299	101,475.85	0.12
237	002153	石基信息	7,210	100,940.00	0.12
238	300957	贝泰妮	1,100	97,768.00	0.11
239	002500	山西证券	17,484	97,560.72	0.11
240	002939	长城证券	11,800	95,934.00	0.11
241	000739	普洛药业	5,400	95,796.00	0.11
242	000887	中鼎股份	7,300	95,557.00	0.11

243	002541	鸿路钢构	3,300	95,073.00	0.11
244	000830	鲁西化工	9,000	95,040.00	0.11
245	000050	深天马 A	10,303	94,581.54	0.11
246	002128	电投能源	7,000	92,540.00	0.11
247	002145	中核钛白	15,695	92,443.55	0.11
248	300529	健帆生物	3,910	90,633.80	0.10
249	301236	软通动力	3,300	89,793.00	0.10
250	300363	博腾股份	3,000	88,770.00	0.10
251	002030	达安基因	8,900	88,733.00	0.10
252	002244	滨江集团	9,800	86,436.00	0.10
253	002487	大金重工	2,800	86,352.00	0.10
254	301269	华大九天	700	85,988.00	0.10
255	300070	碧水源	15,921	85,336.56	0.10
256	002266	浙富控股	20,400	84,252.00	0.10
257	002518	科士达	2,100	84,021.00	0.10
258	002831	裕同科技	3,360	81,950.40	0.09
259	002572	索菲亚	4,700	81,874.00	0.09
260	300357	我武生物	2,400	80,712.00	0.09
261	000709	河钢股份	34,800	78,648.00	0.09
262	002312	川发龙蟒	9,400	76,422.00	0.09
263	000027	深圳能源	11,463	75,541.17	0.09
264	000825	太钢不锈	19,465	75,329.55	0.09
265	000883	湖北能源	16,343	74,524.08	0.09
266	001227	兰州银行	25,700	73,502.00	0.08
267	001965	招商公路	7,600	72,960.00	0.08
268	300776	帝尔激光	1,120	72,688.00	0.08
269	003022	联泓新科	2,900	72,210.00	0.08
270	002791	坚朗五金	1,100	71,181.00	0.08
271	300888	稳健医疗	1,700	70,839.00	0.08
272	002690	美亚光电	2,730	70,297.50	0.08
273	300979	华利集团	1,400	68,236.00	0.08
274	000401	冀东水泥	9,100	67,067.00	0.08
275	003035	南网能源	9,400	66,928.00	0.08
276	000785	居然之家	17,500	66,675.00	0.08
277	002597	金禾实业	2,800	66,080.00	0.08
278	002032	苏泊尔	1,300	65,000.00	0.07
279	000987	越秀资本	9,943	63,138.05	0.07
280	301035	润丰股份	800	62,856.00	0.07
281	300861	美畅股份	1,400	60,718.00	0.07
282	000800	一汽解放	7,200	60,264.00	0.07
283	300850	新强联	1,600	59,808.00	0.07
284	000898	鞍钢股份	19,540	54,321.20	0.06
285	300726	宏达电子	1,200	53,664.00	0.06

286	300171	东富龙	2,300	52,325.00	0.06
287	000958	电投产融	11,300	48,929.00	0.06
288	000537	广宇发展	4,100	47,847.00	0.06
289	301029	怡合达	992	44,322.56	0.05
290	000959	首钢股份	12,200	42,700.00	0.05
291	002608	江苏国信	5,600	42,392.00	0.05
292	002653	海思科	1,700	40,120.00	0.05
293	001872	招商港口	2,100	36,267.00	0.04
294	002945	华林证券	2,500	34,200.00	0.04
295	301308	江波龙	300	30,528.00	0.04
296	002461	珠江啤酒	3,300	29,073.00	0.03
297	002399	海普瑞	2,400	27,528.00	0.03
298	000553	安道麦 A	3,200	27,008.00	0.03
299	001289	龙源电力	1,200	27,000.00	0.03
300	301177	迪阿股份	400	15,372.00	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	300750	宁德时代	318,719.00	0.37
2	600372	中航电子	191,970.24	0.22
3	002262	恩华药业	146,231.00	0.17
4	300487	蓝晓科技	140,229.00	0.16
5	300777	中简科技	138,071.00	0.16
6	002865	钧达股份	124,574.00	0.14
7	002203	海亮股份	123,525.00	0.14
8	301236	软通动力	98,881.00	0.11
9	002541	鸿路钢构	96,052.00	0.11
10	301269	华大九天	86,266.00	0.10
11	002607	中公教育	80,143.00	0.09
12	002518	科士达	79,572.00	0.09
13	001227	兰州银行	59,691.00	0.07
14	300760	迈瑞医疗	59,558.00	0.07
15	300919	中伟股份	57,043.00	0.07
16	002555	三七互娱	50,774.00	0.06

17	002594	比亚迪	50,435.00	0.06
18	300751	迈为股份	45,287.00	0.05
19	002156	通富微电	44,401.00	0.05
20	000792	盐湖股份	40,704.00	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	600372	中航电子	194,834.80	0.22
2	002013	中航机电	191,970.24	0.22
3	300088	长信科技	108,589.40	0.12
4	002456	欧菲光	103,631.95	0.12
5	002936	郑州银行	99,671.76	0.11
6	002958	青农商行	95,785.00	0.11
7	300725	药石科技	79,950.00	0.09
8	000166	申万宏源	71,371.00	0.08
9	300618	寒锐钴业	69,505.00	0.08
10	000858	五粮液	66,151.00	0.08
11	300482	万孚生物	64,881.60	0.07
12	002415	海康威视	60,920.00	0.07
13	002010	传化智联	60,033.00	0.07
14	002594	比亚迪	51,653.00	0.06
15	000333	美的集团	45,744.00	0.05
16	300059	东方财富	45,367.00	0.05
17	000568	泸州老窖	41,546.00	0.05
18	002410	广联达	37,391.00	0.04
19	000651	格力电器	35,911.00	0.04
20	000157	中联重科	32,128.00	0.04

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,748,377.64
卖出股票收入（成交）总额	2,819,517.69

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、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	325.79
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	325.79

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 (%)
2,128	27,466.63	41,285,644.00	70.64	17,163,347.00	29.36	36,914,142.00	63.16

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	胡小彩	2,000,000.00	3.42
2	广发证券股份有限公司	1,553,551.00	2.66
3	中信证券股份有限公司	1,293,360.00	2.21
4	北京无限立通通讯技术有限责任公司	708,499.00	1.21
5	丘立峰	532,100.00	0.91
6	上海旭兴投资管理有限公司-旭兴六号私募证券投资基金	500,000.00	0.86
7	李文聪	265,000.00	0.45
8	丘陵	250,000.00	0.43
9	杜珏	250,000.00	0.43
10	侯小蔓	246,200.00	0.42
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	36,914,142.00	63.16

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、基金投资和相关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	58,448,991.00
本报告期基金总申购份额	-

减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	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形。

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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总 额的比例 (%)		金总量的 比例 (%)	
东方 证券	5	6,183,954.85	100.00	4,460.57	100.00	
长城 证券	2	-	-	-	-	
长江 证券	1	-	-	-	-	
东北 证券	2	-	-	-	-	
东吴 证券	1	-	-	-	-	
东兴 证券	1	-	-	-	-	
广发 证券	1	-	-	-	-	
国海 证券	2	-	-	-	-	
国泰 君安	1	-	-	-	-	
国信 证券	2	-	-	-	-	
海通 证券	1	-	-	-	-	
恒泰 证券	2	-	-	-	-	
华泰 证券	2	-	-	-	-	
华西 证券	1	-	-	-	-	
平安 证券	1	-	-	-	-	
瑞银 证券	2	-	-	-	-	
申万 宏源 证券	1	-	-	-	-	
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	
信达 证券	1	-	-	-	-	
兴业	1	-	-	-	-	

证券						
银河证券	1	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信建投证券	1	-	-	-	-	
中信证券	2	-	-	-	-	
中银国际	1	-	-	-	-	

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

(2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
2	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 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东海证券为申购赎回代理券商的公告	上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 16 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
5	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, 深交所, 中国证监会	2023 年 04 月 14 日

		基金电子披露网站	
6	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及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 17 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
8	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2023 年 5 月 23 日更新)	公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 23 日
9	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, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 23 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
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	1	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	36,914,142.00	-	-	36,914,142.00	63.16

证券 投资 基金 联接 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

2023 年 08 月 31 日