

汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2012 年 8 月 28 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。本半年度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 2012 年 8 月 24 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 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	41
7.10 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42

§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
§11 备查文件目录	47
11.1 备查文件目录.....	47
11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	汇添富深证 300ETF 联接
基金主代码	470068
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 28 日
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
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	155,705,809.48 份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159912
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 09 月 16 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 11 月 24 日
基金管理人名称	汇添富基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以深证 300 交易型开放式指数证券投资基金作为其主要投资标的，并不参与目标 ETF 的管理。本基金主要以一级市场申购的方式投资于目标 ETF，获取基金份额净值上涨带来的收益；在目标 ETF 基金份额二级市场交易流动性较好的情况下，也可以通过二级市场买卖目标 ETF 的基金份额。
业绩比较基准	深证 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法。正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	深证 300 指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 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	李文	赵会军
	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		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		潘鑫军	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层汇添富基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层

§ 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(2012年1月1日 - 2012年6月30日)
本期已实现收益	1,896,624.46
本期利润	16,296,147.03
加权平均基金份额本期利润	0.1007
本期加权平均净值利润率	10.26%
本期基金份额净值增长率	6.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配利润	-4,723,696.86
期末可供分配基金份额利润	-0.0303
期末基金资产净值	150,982,112.62
期末基金份额净值	0.9697
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-3.03%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上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

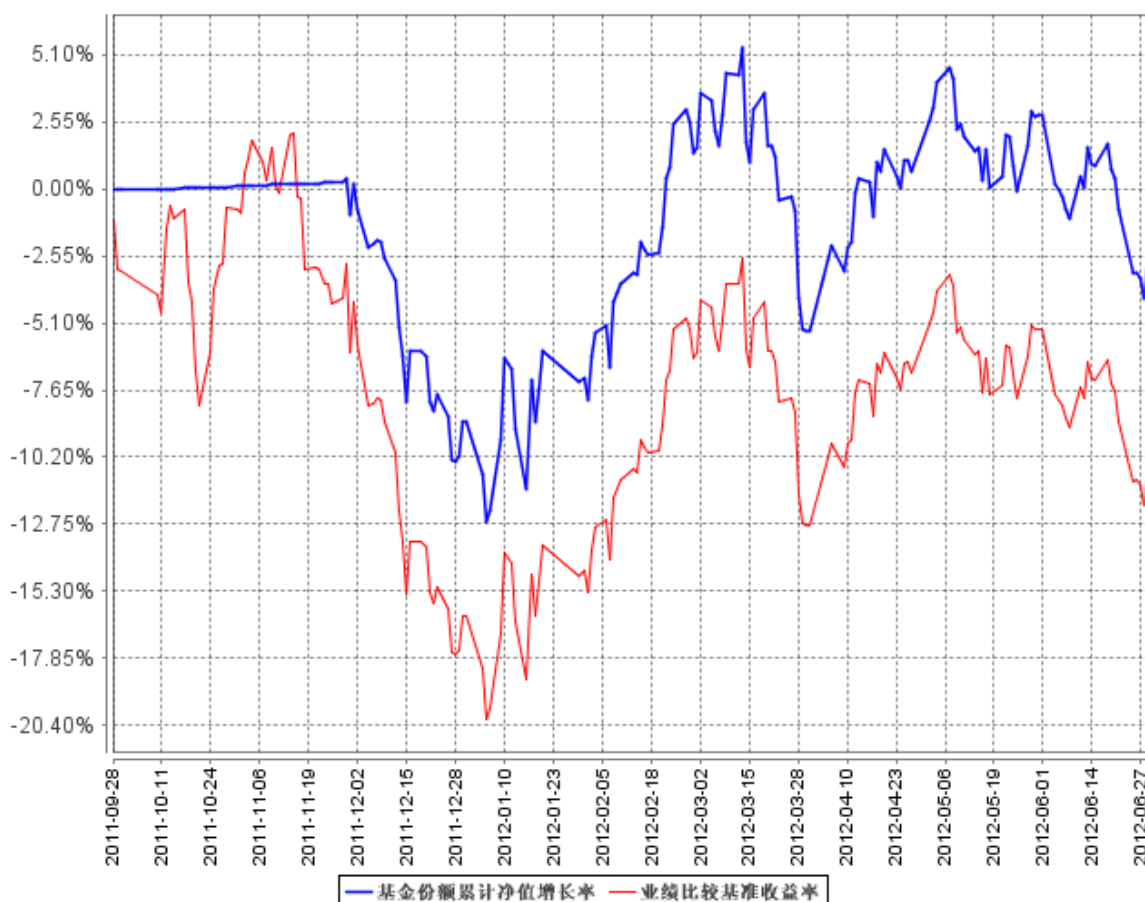
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.67%	1.05%	-6.00%	1.08%	0.33%	-0.03%
过去三个月	2.55%	1.09%	2.10%	1.14%	0.45%	-0.05%
过去六个月	6.37%	1.35%	6.32%	1.43%	0.05%	-0.08%
自基金合同生效日起至 今	-3.03%	1.16%	-10.98%	1.45%	7.95%	-0.29%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 9 月 28 日，至本报告期末未满一年。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 9 月 28 日，截至本报告期末，基金成立未满 1 年；本基金建仓期为自《基金合同》生效之日（2011 年 9 月 28 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金戎控股有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立，注册资本金为 1 亿元人民币。截止到 2012 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模达到 803.69 亿元，基金份额持有人户数近 200 万，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 22 只开放式证券投资基金，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金（A 级、B 级）、汇添富均衡增长股票型证券投资基金、汇添富成长焦点股票型证券投资基金、汇添富增强

收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富保本混合型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金。

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	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理，汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理，深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。	2011 年 9 月 28 日	-	6 年	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程研究员，2010 年 1 月 8 日至 2010 年 2 月 4 日任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理助理，2010 年 2 月 5 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理，2011 年 9 月 16 日至今任深证 300 交易型开放式指数证

					券投资基金的基金经理，2011 年 9 月 28 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。
赖中立	本基金的基金经理助理	2012 年 2 月 15 日	-	5 年	国籍：中国，学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士，相关业务资格：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有限公司，任金融工程部分分析师。2012 年 2 月 15 日至今任汇添富上证综合指数基金、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、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助理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基

金无重大违法、违规行为，本基金投资组合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

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各投资组合、各投资市场、各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人对投资交易全过程实施了严格的监控、分析和检查，未发现任何异常交易行为。

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

2012 年上半年通货膨胀加速回调，从经济基本面和政策两方面来看，一方面经济数据持续恶化，另一方面降准和降息同时并行，在这两种因素主导下，A 股市场在上半年走出了先扬后抑的行情。本基金在报告期内遵循了指数基金的被动投资原则，在建仓期结束后保持了指数基金的本质属性，ETF 和股票投资仓位在建仓期结束后始终保持在 92%~95%之间，在现货构建方面以深证 300ETF 为主要投资品，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

深证 300 指数在报告期内上涨了 6.64%，本基金在报告期内累计收益率为 6.37%，同期业绩比较基准收益率为 6.32%，收益率领先业绩比较基准 0.05%。收益率的差异因素主要来源于仓位不足 95%、日常申购赎回等因素。本基金在考察期内日均跟踪误差为 0.097%，尽管报告期前期尚处于建仓期，但这一跟踪误差水平远低于合同约定上限，在报告期达到了投资目标。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间，本基金倾向于认为 CPI 和经济增速都会处于一个筑底过程，前期的货币放松也将抑制通胀的下行空间，这也很大程度上抑制了政策进一步放松的力度，需要关注成品油、食品等价格的变化方向，由于前期 PPI 数据的快速下滑，企业盈利水平料将出现较大的下滑，上市公司半年报期待不大，另外进出口增速的基础是不稳定的，房地产市场的调控仍将保持一定力度，在此种大背景下，央行在短期可能继续施行结构型积极的财政政策和微调的货币政策。外围市场中，全球经济复苏持续放缓，美国经济数据时好时坏，希腊问题短期虽然有所缓解，但欧债问题长期仍待解决，从而继续影响我国的外需增速。从保增长和确保经济软着陆的角度来看，政策在短期可能出现超预期，这将给股票市场带来短期的投资机会。

整体来看，2012 年 A 股市场将处于底部震荡形态，目前 A 股市场经过前期的大幅调整，估值水平已处于历史低位，下降空间相对有限。如果经济筑底成功，A 股市场将出现较好的投资机会，目前也是投资者逐步进场的可选择时机，深证 300ETF 联接基金是个弹性较大的指数品种，是投资者长期投资和定期定投较好的投资选择。

作为被动投资的指数型基金，汇添富深证 300ETF 联接基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的指数化投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。我们也非常期望汇添富深证 300ETF 联接基金能继续与投资者一起分享中国经济的美好未来。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、产品创新部、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

§ 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

2012 年上半年，本基金托管人在对汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2012 年上半年，汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人--汇添富基金管理有限公司在汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度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有限公司编制和披露的汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2012 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	8,797,598.31	25,934,114.02
结算备付金		313,980.54	4,896,662.48
存出保证金		250,000.00	-
交易性金融资产	6.4.7.2	141,579,301.09	180,924,567.18
其中: 股票投资		1,373,512.03	1,471,767.18
基金投资		140,205,789.06	179,452,800.00
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,673.05	7,612.78
应收股利		-	-
应收申购款		516,547.59	24,004.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	12,090.40
资产总计		151,459,100.58	211,799,051.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,099.33	117,065.86
应付管理人报酬		4,070.04	36,916.23
应付托管费		814.00	7,383.23
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	31,035.19	16,874.95
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
其他负债		438,969.40	120,441.19
递延所得税负债	6.4.7.8	-	-
负债合计		476,987.96	298,681.46
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	155,705,809.48	232,005,810.56
未分配利润	6.4.7.10	-4,723,696.86	-20,505,440.73
所有者权益合计		150,982,112.62	211,500,369.83
负债和所有者权益总计		151,459,100.58	211,799,051.29

注：1、报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9697 元，基金份额总额 155,705,809.48 份。

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		16,690,757.33
1.利息收入		46,778.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	46,778.93
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）		2,076,019.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-28,178.49
基金投资收益	6.4.7.13	2,097,480.30
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	6,718.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	14,399,522.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	168,435.97
减：二、费用		394,610.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	31,907.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,381.43
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	167,291.24
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	189,030.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,296,147.03

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、由于本基金于 2011 年 9 月 28 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示本期数据，特此说明。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	232,005,810.56	-20,505,440.73	211,500,369.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,296,147.03	16,296,147.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-76,300,001.08	-514,403.16	-76,814,404.24
其中：1.基金申购款	57,329,598.28	601,958.62	57,931,556.90
2.基金赎回款	-133,629,599.36	-1,116,361.78	-134,745,961.14
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	155,705,809.48	-4,723,696.86	150,982,112.62

注：由于本基金于 2011 年 9 月 28 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益(基金净值)变动表只列示本期数据，特此说明。

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：

林利军

基金管理公司负责人

陈灿辉

主管会计工作负责人

王小练

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]886 号文《关于核准深证 300 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准,由汇添富基金管理有限公司作为发起人于 2011 年 8 月 26 日至 2011 年 9 月 26 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所

所验证并出具安永华明(2011)验字第 60466941_B09 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2011 年 9 月 28 日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 335,957,007.02 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 48,341.17 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 336,005,348.19 元,折合 336,005,348.19 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构为汇添富基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金以深证 300 指数为跟踪标的,通过投资目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股等,使基金份额持有人能够以较低的成本获得与标的指数一致的投资回报。本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股。其中投资于目标 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,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。本基金业绩比较基准为深证 300 指数收益率 $\times 95\%$ +银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、证监会公告[2010]5 号关于发布《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年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一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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、国家税务总局财税字[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. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

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 2012 年 6 月 30 日
活期存款	8,797,598.31
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	8,797,598.31

注：本基金本期末未投资于定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,407,175.76	1,373,512.03	-33,663.73
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	146,582,438.61	140,205,789.06	-6,376,649.55
其他	-	-	-
合计	147,989,614.37	141,579,301.09	-6,410,313.28

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,545.88
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	127.17
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	1,673.05

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	31,035.19
银行间市场应付交易费用	-
合计	31,035.19

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	7.90
预提审计费	19,890.78
预提信息披露费	169,070.72
合计	438,969.40

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	232,005,810.56	232,005,810.56
本期申购	57,329,598.28	57,329,598.28

本期赎回(以“-”号填列)	-133,629,599.36	-133,629,599.36
本期末	155,705,809.48	155,705,809.48

注：本期申购中包含红利再投、转换入份额，本期赎回中包含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,420,488.11	-17,084,952.62	-20,505,440.73
本期利润	1,896,624.46	14,399,522.57	16,296,147.03
本期基金份额交易产生的变动数	1,146,495.72	-1,660,898.88	-514,403.16
其中：基金申购款	-231,954.55	833,913.17	601,958.62
基金赎回款	1,378,450.27	-2,494,812.05	-1,116,361.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-377,367.93	-4,346,328.93	-4,723,696.86

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	43,177.49
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	3,398.00
其他	203.44
合计	46,778.93

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-252,834.88
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	224,656.39
合计	-28,178.49

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	65,656,724.24
减：卖出股票成本总额	65,909,559.12

买卖股票差价收入	-252,834.88
----------	-------------

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	37,465,595.37
减：现金支付申购款总额	1,664,061.13
减：申购股票成本总额	35,576,877.85
申购差价收入	224,656.39

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	93,854,374.64
减：卖出/赎回基金成本总额	91,756,894.34
基金投资收益	2,097,480.30

6.4.7.14 债券投资收益

注：本基金本报告期末有债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本期未投资衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,718.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,718.05

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	14,399,522.57
——股票投资	98,064.68
——债券投资	-
——基金投资	14,301,457.89

——资产支持证券投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	14,399,522.57

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	168,435.97
合计	168,435.97

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	167,291.24
银行间市场交易费用	-
合计	167,291.24

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	169,070.72
银行划款费用	69.00
合计	189,030.50

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

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
汇添富基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控控股有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

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 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东方证券股份有限公司	101,630,813.38	100.00%

6.4.10.1.2 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例
东方证券股份有限公司	28,962,460.91	100.00%

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6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
东方证券股份有限公司	76,312.25	100.00%	31,035.19	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	31,907.13
其中：支付销售机构的客户维护费	51,141.54

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,381.43

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.1% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前 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：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2011 年 9 月 28 日）持有的基金份额	-
期初持有的基金份额	30,005,750.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	30,005,750.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.27%

注：1、本公司于 2011 年 9 月 21 日运用自有资金 30,000,000.00 元认购本基金份额 30,005,750.00 份（含募集期利息结转的份额），认购费用 1,000.00 元，符合招募说明书规定的认购费率。

2、本基金于 2011 年 9 月 28 日成立，无上年度可比期间。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

6.4.10.5 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	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	8,797,598.31	43,177.49

注：由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入包含了关联方保管的银行存款期末余额、除了最低备付金以外的结算备付金期末余额及当期产生的利息收入。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 156,899,943 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 52.44%。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2012 年 6 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：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000059	辽通化工	2012 年 6 月 26 日	重大事项停牌	7.91	2012 年 7 月 3 日	8.15	500	4,275.00	3,955.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及部分应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6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	8,797,598.31	-	-	-	-	-	8,797,598.31
结算备付金	313,980.54	-	-	-	-	-	313,980.54
存出保证金	-	-	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	141,579,301.09	141,579,301.09
应收利息	-	-	-	-	-	1,673.05	1,673.05
应收申购款	87,915.14	-	-	-	-	428,632.45	516,547.59

资产总计	9,199,493.99	-	-	-	-	142,259,606.59	151,459,100.58
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,099.33	2,099.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,070.04	4,070.04
应付托管费	-	-	-	-	-	814.00	814.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	31,035.19	31,035.19
其他负债	-	-	-	-	-	438,969.40	438,969.40
负债总计	-	-	-	-	-	476,987.96	476,987.96
利率敏感度缺口	9,199,493.99	-	-	-	-	141,782,618.63	150,982,112.62
上年度末 2011 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	25,934,114.02	-	-	-	-	-	25,934,114.02
结算备付金	4,896,662.48	-	-	-	-	-	4,896,662.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	180,924,567.18	180,924,567.18
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	7,612.78	7,612.78
应收申购款	198.81	-	-	-	-	23,805.62	24,004.43
其他资产	-	-	-	-	-	12,090.40	12,090.40
资产总计	30,830,975.31	-	-	-	-	180,968,075.98	211,799,051.29
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	117,065.86	117,065.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	36,916.23	36,916.23
应付托管费	-	-	-	-	-	7,383.23	7,383.23
应付交易费用	-	-	-	-	-	16,874.95	16,874.95
其他负债	-	-	-	-	-	120,441.19	120,441.19
负债总计	-	-	-	-	-	298,681.46	298,681.46
利率敏感度缺口	30,830,975.31	-	-	-	-	180,669,394.52	211,500,369.83

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期期末计息资产仅包括银行存款及应收申购款、结算备付金，且均以活期存款利率

或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本期期末未持有其他资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

6.4.13.4.2 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	1,373,512.03	0.91	1,471,767.18	0.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	179,452,800.00	84.85
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,373,512.03	0.91	180,924,567.18	85.54

注：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）、目标 ETF、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股。其中投资于目标 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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。

6.4.13.4.2.2 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，即与所投资证券的贝塔系数紧密相关； 2. 对于上市时间不足一年的股票，使用申银万国行业指数替代股票价格计算其贝
----	--

	塔系数；		
	3. 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（2012年6月30日）	上年度末（2011年12月31日）
	深证 300 指数上涨 5%	7,214,400.82	9,411,031.19
	深证 300 指数下跌 5%	-7,214,400.82	-9,411,031.19

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

6.4.14 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	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,373,512.03	0.91
	其中：股票	1,373,512.03	0.91
2	基金投资	140,205,789.06	92.57
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,111,578.85	6.02
7	其他各项资产	768,220.64	0.51
8	合计	151,459,100.58	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	22,650.00	0.02
B	采掘业	66,645.20	0.04
C	制造业	828,126.95	0.55

C0	食品、饮料	151,819.30	0.10
C1	纺织、服装、皮毛	13,924.00	0.01
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	8,284.00	0.01
C4	石油、化学、塑胶、塑料	87,114.45	0.06
C5	电子	74,231.00	0.05
C6	金属、非金属	144,918.00	0.10
C7	机械、设备、仪表	249,061.20	0.16
C8	医药、生物制品	94,071.00	0.06
C99	其他制造业	4,704.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	17,904.00	0.01
E	建筑业	12,928.60	0.01
F	交通运输、仓储业	15,389.00	0.01
G	信息技术业	53,754.00	0.04
H	批发和零售贸易	60,929.48	0.04
I	金融、保险业	88,547.00	0.06
J	房地产业	130,112.00	0.09
K	社会服务业	38,025.80	0.03
L	传播与文化产业	9,075.00	0.01
M	综合类	29,425.00	0.02
	合计	1,373,512.03	0.91

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万 科 A	6,700	59,697.00	0.04
2	000858	五 粮 液	1,400	45,864.00	0.03
3	000651	格力电器	1,700	35,445.00	0.02
4	000157	中联重科	3,200	32,096.00	0.02
5	000001	深发展 A	2,000	30,320.00	0.02
6	002024	苏宁电器	3,300	27,687.00	0.02
7	000568	泸州老窖	500	21,155.00	0.01
8	000063	中兴通讯	1,500	20,940.00	0.01
9	000983	西山煤电	1,200	18,720.00	0.01
10	002304	洋河股份	136	18,298.80	0.01
11	000776	广发证券	600	17,898.00	0.01
12	000338	潍柴动力	600	17,814.00	0.01
13	000792	盐湖股份	500	16,885.00	0.01
14	000423	东阿阿胶	400	16,004.00	0.01
15	000527	美的电器	1,400	15,470.00	0.01

16	000629	攀钢钒钛	2,000	13,160.00	0.01
17	000425	徐工机械	900	12,906.00	0.01
18	000069	华侨城 A	2,000	12,760.00	0.01
19	000402	金融街	1,900	12,407.00	0.01
20	000895	双汇发展	200	12,376.00	0.01
21	000024	招商地产	500	12,265.00	0.01
22	000100	TCL 集团	5,900	11,977.00	0.01
23	000970	中科三环	300	11,904.00	0.01
24	000538	云南白药	200	11,856.00	0.01
25	000630	铜陵有色	600	11,580.00	0.01
26	000783	长江证券	1,200	10,920.00	0.01
27	000799	酒鬼酒	200	10,480.00	0.01
28	002422	科伦药业	200	9,332.00	0.01
29	000039	中集集团	700	9,310.00	0.01
30	000937	冀中能源	600	9,162.00	0.01
31	000623	吉林敖东	520	9,016.80	0.01
32	002142	宁波银行	900	8,982.00	0.01
33	000878	云南铜业	500	8,950.00	0.01
34	000869	张裕 A	130	8,743.80	0.01
35	000060	中金岭南	1,000	8,620.00	0.01
36	000709	河北钢铁	3,100	8,463.00	0.01
37	000581	威孚高科	300	8,220.00	0.01
38	002155	辰州矿业	420	8,131.20	0.01
39	000012	南玻 A	900	8,100.00	0.01
40	000960	锡业股份	400	7,880.00	0.01
41	000728	国元证券	700	7,637.00	0.01
42	002081	金螳螂	200	7,600.00	0.01
43	000758	中色股份	400	7,588.00	0.01
44	002241	歌尔声学	200	7,298.00	0.00
45	000768	西飞国际	900	7,065.00	0.00
46	002202	金风科技	1,100	7,051.00	0.00
47	000422	湖北宜化	573	7,019.25	0.00
48	000009	中国宝安	700	7,000.00	0.00
49	000562	宏源证券	400	6,616.00	0.00
50	000800	一汽轿车	600	6,516.00	0.00
51	002038	双鹭药业	200	6,440.00	0.00
52	000933	神火股份	700	6,384.00	0.00
53	000625	长安汽车	1,300	6,344.00	0.00
54	000528	柳工	500	6,205.00	0.00

55	002236	大华股份	200	6,140.00	0.00
56	000930	中粮生化	1,245	6,050.70	0.00
57	002106	莱宝高科	300	6,021.00	0.00
58	000825	太钢不锈	1,700	6,001.00	0.00
59	300070	碧水源	200	5,980.00	0.00
60	000729	燕京啤酒	800	5,840.00	0.00
61	002385	大北农	300	5,820.00	0.00
62	000401	冀东水泥	400	5,624.00	0.00
63	002029	七匹狼	200	5,560.00	0.00
64	002415	海康威视	200	5,440.00	0.00
65	000963	华东医药	180	5,436.00	0.00
66	000839	中信国安	800	5,376.00	0.00
67	002092	中泰化学	700	5,355.00	0.00
68	000778	新兴铸管	800	5,352.00	0.00
69	000998	隆平高科	300	5,349.00	0.00
70	000939	凯迪电力	600	5,088.00	0.00
71	002007	华兰生物	200	4,916.00	0.00
72	000969	安泰科技	400	4,892.00	0.00
73	000718	苏宁环球	600	4,860.00	0.00
74	300027	华谊兄弟	300	4,749.00	0.00
75	000661	长春高新	100	4,726.00	0.00
76	000596	古井贡酒	100	4,724.00	0.00
77	002001	新和成	220	4,648.60	0.00
78	000826	桑德环境	200	4,580.00	0.00
79	000876	新希望	300	4,494.00	0.00
80	000540	中天城投	600	4,428.00	0.00
81	300024	机器人	200	4,414.00	0.00
82	000690	宝新能源	1,000	4,390.00	0.00
83	000680	山推股份	750	4,387.50	0.00
84	002146	荣盛发展	400	4,360.00	0.00
85	000793	华闻传媒	700	4,326.00	0.00
86	000762	西藏矿业	300	4,296.00	0.00
87	000898	鞍钢股份	1,100	4,290.00	0.00
88	002073	软控股份	500	4,190.00	0.00
89	002069	獐子岛	200	4,170.00	0.00
90	000807	云铝股份	700	4,123.00	0.00
91	000759	中百集团	542	4,032.48	0.00
92	000046	泛海建设	900	4,023.00	0.00
93	000518	四环生物	900	4,014.00	0.00

94	000059	辽通化工	500	3,955.00	0.00
95	002230	科大讯飞	200	3,940.00	0.00
96	002128	露天煤业	300	3,924.00	0.00
97	000877	天山股份	400	3,900.00	0.00
98	002237	恒邦股份	100	3,898.00	0.00
99	000027	深圳能源	600	3,882.00	0.00
100	002167	东方锆业	200	3,784.00	0.00
101	002008	大族激光	600	3,768.00	0.00
102	000816	江淮动力	700	3,745.00	0.00
103	000961	中南建设	300	3,738.00	0.00
104	000926	福星股份	400	3,736.00	0.00
105	000049	德赛电池	100	3,530.00	0.00
106	000848	承德露露	200	3,510.00	0.00
107	000503	海虹控股	600	3,486.00	0.00
108	000612	焦作万方	300	3,483.00	0.00
109	000752	西藏发展	200	3,482.00	0.00
110	002051	中工国际	130	3,452.80	0.00
111	000541	佛山照明	400	3,452.00	0.00
112	000650	仁和药业	400	3,432.00	0.00
113	000686	东北证券	200	3,428.00	0.00
114	002123	荣信股份	300	3,411.00	0.00
115	002152	广电运通	200	3,300.00	0.00
116	000598	兴蓉投资	400	3,260.00	0.00
117	002022	科华生物	300	3,255.00	0.00
118	000860	顺鑫农业	200	3,204.00	0.00
119	002011	盾安环境	300	3,195.00	0.00
120	002056	横店东磁	200	3,184.00	0.00
121	000031	中粮地产	700	3,178.00	0.00
122	000780	平庄能源	300	3,144.00	0.00
123	000400	许继电气	200	3,134.00	0.00
124	000652	泰达股份	800	3,128.00	0.00
125	002277	友阿股份	200	3,122.00	0.00
126	002005	德豪润达	400	3,112.00	0.00
127	000407	胜利股份	500	3,095.00	0.00
128	000488	晨鸣纸业	700	3,059.00	0.00
129	000968	煤气化	200	3,050.00	0.00
130	000997	新大陆	300	3,045.00	0.00
131	000511	银基发展	800	3,040.00	0.00
132	000667	名流置业	1,400	3,024.00	0.00

133	000559	万向钱潮	600	3,018.00	0.00
134	000996	中国中期	200	2,990.00	0.00
135	000028	国药一致	100	2,978.00	0.00
136	000501	鄂武商 A	200	2,976.00	0.00
137	002223	鱼跃医疗	200	2,970.00	0.00
138	000636	风华高科	400	2,960.00	0.00
139	001696	宗申动力	500	2,960.00	0.00
140	000616	亿城股份	800	2,928.00	0.00
141	000627	天茂集团	900	2,925.00	0.00
142	002025	航天电器	200	2,910.00	0.00
143	002063	远光软件	200	2,902.00	0.00
144	000735	罗牛山	600	2,898.00	0.00
145	002299	圣农发展	200	2,888.00	0.00
146	000897	津滨发展	1,000	2,860.00	0.00
147	000006	深振业 A	500	2,855.00	0.00
148	000900	现代投资	200	2,848.00	0.00
149	000683	远兴能源	500	2,825.00	0.00
150	000823	超声电子	200	2,790.00	0.00
151	000973	佛塑科技	600	2,790.00	0.00
152	000513	丽珠集团	100	2,779.00	0.00
153	002233	塔牌集团	300	2,772.00	0.00
154	000988	华工科技	200	2,754.00	0.00
155	000078	海王生物	400	2,748.00	0.00
156	000563	陕国投 A	200	2,746.00	0.00
157	002154	报喜鸟	200	2,726.00	0.00
158	002244	滨江集团	300	2,721.00	0.00
159	000850	华茂股份	400	2,720.00	0.00
160	000659	珠海中富	800	2,704.00	0.00
161	002294	信立泰	100	2,700.00	0.00
162	000021	长城开发	500	2,690.00	0.00
163	000962	东方钨业	200	2,672.00	0.00
164	000795	太原刚玉	200	2,644.00	0.00
165	000525	红太阳	200	2,620.00	0.00
166	000829	天音控股	400	2,608.00	0.00
167	000789	江西水泥	200	2,606.00	0.00
168	000786	北新建材	200	2,588.00	0.00
169	002122	天马股份	400	2,584.00	0.00
170	002129	中环股份	200	2,570.00	0.00
171	000959	首钢股份	900	2,565.00	0.00

172	002153	石基信息	100	2,565.00	0.00
173	000417	合肥百货	200	2,510.00	0.00
174	000975	科学城	300	2,490.00	0.00
175	000571	新大洲A	500	2,485.00	0.00
176	002269	美邦服饰	100	2,410.00	0.00
177	002405	四维图新	200	2,388.00	0.00
178	000159	国际实业	300	2,370.00	0.00
179	000036	华联控股	600	2,358.00	0.00
180	002161	远望谷	300	2,322.00	0.00
181	000682	东方电子	700	2,317.00	0.00
182	000601	韶能股份	600	2,292.00	0.00
183	000572	海马汽车	700	2,282.00	0.00
184	000410	沈阳机床	300	2,271.00	0.00
185	000830	鲁西化工	500	2,270.00	0.00
186	000931	中关村	400	2,260.00	0.00
187	002254	泰和新材	200	2,258.00	0.00
188	000655	金岭矿业	200	2,246.00	0.00
189	002168	深圳惠程	240	2,227.20	0.00
190	002028	思源电气	200	2,218.00	0.00
191	000717	韶钢松山	900	2,205.00	0.00
192	000927	一汽夏利	300	2,199.00	0.00
193	000537	广宇发展	300	2,157.00	0.00
194	000755	山西三维	300	2,157.00	0.00
195	000550	江铃汽车	100	2,135.00	0.00
196	002006	精功科技	200	2,128.00	0.00
197	002399	海普瑞	100	2,120.00	0.00
198	002048	宁波华翔	300	2,103.00	0.00
199	000777	中核科技	100	2,099.00	0.00
200	002041	登海种业	100	2,079.00	0.00
201	000886	海南高速	600	2,076.00	0.00
202	000713	丰乐种业	200	2,062.00	0.00
203	000089	深圳机场	500	2,045.00	0.00
204	000088	盐田港	500	2,040.00	0.00
205	300077	国民技术	100	2,031.00	0.00
206	000731	四川美丰	300	2,001.00	0.00
207	000698	沈阳化工	400	1,996.00	0.00
208	002594	比亚迪	100	1,986.00	0.00
209	002191	劲嘉股份	200	1,984.00	0.00
210	000066	长城电脑	500	1,970.00	0.00

211	002190	成飞集成	130	1,969.50	0.00
212	002408	齐翔腾达	120	1,951.20	0.00
213	002052	同洲电子	200	1,950.00	0.00
214	000707	双环科技	300	1,941.00	0.00
215	000790	华神集团	200	1,928.00	0.00
216	000822	山东海化	400	1,912.00	0.00
217	002182	云海金属	200	1,884.00	0.00
218	000042	深 长 城	100	1,873.00	0.00
219	002104	恒宝股份	200	1,870.00	0.00
220	000416	民生投资	300	1,848.00	0.00
221	002030	达安基因	240	1,845.60	0.00
222	002183	怡 亚 通	300	1,839.00	0.00
223	000708	大冶特钢	200	1,824.00	0.00
224	000936	华西股份	400	1,804.00	0.00
225	300002	神州泰岳	100	1,803.00	0.00
226	002083	孚日股份	400	1,796.00	0.00
227	000301	东方市场	600	1,788.00	0.00
228	002097	山河智能	200	1,736.00	0.00
229	000099	中信海直	200	1,734.00	0.00
230	002078	太阳纸业	300	1,731.00	0.00
231	000554	泰山石油	300	1,719.00	0.00
232	000903	云内动力	400	1,700.00	0.00
233	000887	中鼎股份	200	1,698.00	0.00
234	000881	大连国际	200	1,696.00	0.00
235	000828	东莞控股	300	1,656.00	0.00
236	000532	力合股份	200	1,650.00	0.00
237	000989	九 芝 堂	100	1,620.00	0.00
238	002064	华峰氨纶	300	1,617.00	0.00
239	002130	沃尔核材	150	1,593.00	0.00
240	000090	深 天 健	220	1,590.60	0.00
241	002109	兴化股份	200	1,548.00	0.00
242	002493	荣盛石化	100	1,533.00	0.00
243	000833	贵糖股份	200	1,510.00	0.00
244	000687	保定天鹅	300	1,494.00	0.00
245	002242	九阳股份	200	1,472.00	0.00
246	000977	浪潮信息	100	1,451.00	0.00
247	000428	华天酒店	300	1,404.00	0.00
248	000543	皖能电力	200	1,402.00	0.00
249	002249	大洋电机	150	1,395.00	0.00

250	000987	广州友谊	100	1,322.00	0.00
251	300003	乐普医疗	100	1,321.00	0.00
252	000050	深天马 A	200	1,306.00	0.00
253	000819	岳阳兴长	100	1,282.00	0.00
254	000851	高鸿股份	200	1,280.00	0.00
255	002176	江特电机	100	1,266.00	0.00
256	000533	万家乐	300	1,257.00	0.00
257	002032	苏泊尔	100	1,254.00	0.00
258	000679	大连友谊	200	1,242.00	0.00
259	002013	中航精机	100	1,220.00	0.00
260	000951	中国重汽	100	1,214.00	0.00
261	000949	新乡化纤	400	1,196.00	0.00
262	002079	苏州固锴	200	1,188.00	0.00
263	002136	安纳达	100	1,143.00	0.00
264	000901	航天科技	100	1,134.00	0.00
265	002017	东信和平	100	1,125.00	0.00
266	000158	常山股份	300	1,122.00	0.00
267	002362	汉王科技	100	1,109.00	0.00
268	002093	国脉科技	200	1,082.00	0.00
269	002171	精诚铜业	100	1,058.00	0.00
270	002091	江苏国泰	100	1,039.00	0.00
271	000928	中钢吉炭	100	1,024.00	0.00
272	000514	渝开发	200	1,022.00	0.00
273	002080	中材科技	100	1,017.00	0.00
274	000635	英力特	100	986.00	0.00
275	000911	南宁糖业	100	981.00	0.00
276	000727	华东科技	200	968.00	0.00
277	000868	安凯客车	100	927.00	0.00
278	002156	通富微电	200	920.00	0.00
279	000701	厦门信达	100	873.00	0.00
280	000600	建投能源	200	850.00	0.00
281	002225	濮耐股份	100	756.00	0.00
282	000029	深深房 A	200	748.00	0.00
283	000597	东北制药	100	690.00	0.00
284	000761	本钢板材	100	423.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科 A	1,506,217.93	0.71
2	000858	五粮液	1,188,572.00	0.56
3	000651	格力电器	966,148.00	0.46
4	000001	深发展 A	822,865.96	0.39
5	002024	苏宁电器	818,334.80	0.39
6	000157	中联重科	813,334.00	0.38
7	000063	中兴通讯	603,958.30	0.29
8	000568	泸州老窖	551,180.00	0.26
9	000983	西山煤电	522,362.00	0.25
10	000527	美的电器	504,700.00	0.24
11	000338	潍柴动力	496,467.00	0.23
12	000776	广发证券	470,544.50	0.22
13	000629	攀钢钒钛	411,905.00	0.19
14	000423	东阿阿胶	410,484.32	0.19
15	000792	盐湖股份	406,233.00	0.19
16	000069	华侨城 A	383,140.00	0.18
17	000100	TCL 集团	340,371.00	0.16
18	000425	徐工机械	333,670.54	0.16
19	000402	金融街	327,855.00	0.16
20	000630	铜陵有色	323,987.57	0.15

注：买入金额按买卖成交金额填列，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	000002	万科 A	2,518,537.08	1.19
2	000858	五粮液	2,084,950.57	0.99
3	000651	格力电器	1,582,801.76	0.75
4	000001	深发展 A	1,480,911.86	0.70
5	002024	苏宁电器	1,432,458.67	0.68
6	000157	中联重科	1,384,588.76	0.65

7	002304	洋河股份	1,333,278.96	0.63
8	000063	中兴通讯	1,054,282.80	0.50
9	000568	泸州老窖	928,125.68	0.44
10	000338	潍柴动力	909,624.85	0.43
11	000527	美的电器	876,137.55	0.41
12	000983	西山煤电	867,986.70	0.41
13	000792	盐湖股份	800,584.93	0.38
14	000776	广发证券	766,786.39	0.36
15	000423	东阿阿胶	743,584.09	0.35
16	000069	华侨城 A	667,963.58	0.32
17	000629	攀钢钒钛	629,324.67	0.30
18	000425	徐工机械	616,647.53	0.29
19	000100	TCL 集团	612,648.28	0.29
20	000895	双汇发展	596,188.36	0.28

注：卖出金额按买卖成交金额填列，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	35,974,089.14
卖出股票收入（成交）总额	65,656,724.24

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名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名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	------	-----	---------	--------------

1	深 300ETF	股票型	交易型开 放式	汇添富基 金管理有 限公司	140,205,789.06	92.86
---	----------	-----	------------	---------------------	----------------	-------

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.10.3 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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,673.05
5	应收申购款	516,547.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	768,220.64

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

§ 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	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,537.00	44,022.00	88,262,752.81	56.69%	67,443,056.67	43.31%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
----	------------	----------

基金管理公司所有从业人员持有本基金	1,395,634.41	0.90%
-------------------	--------------	-------

注：1) 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

2) 该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

§ 9 开放式基金份额变动

份额单位：份

基金合同生效日 (2011 年 9 月 28 日) 基金份额总额	336,005,348.19
本报告期期初基金份额总额	232,005,810.56
本报告期基金总申购份额	57,329,598.28
减：本报告期基金总赎回份额	133,629,599.36
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	155,705,809.48

注：表内“总申购份额”含转换入份额；“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

1、基金管理人 2012 年 3 月 3 日公告，增聘韩贤旺先生、叶从飞先生担任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，与苏竞先生共同管理该基金。同时，陈晓翔先生、欧阳沁春先生不再担任该基金的基金经理。

2、基金管理人 2012 年 3 月 3 日公告，增聘周睿先生担任汇添富医疗保健股票型证券投资基金的基金经理，由其与王栩先生共同管理该基金。

3、《汇添富逆向投资股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 9 日正式生效，顾耀强先生任该基金的基金经理。

4、基金管理人于 2012 年 3 月 14 日公告，聘请雷继明先生担任本公司副总经理。

5、《汇添富理财 30 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 9 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2012 年 6 月 7 日公告，潘鑫军先生担任本公司董事长，桂水发先生不再担任本公司的董事长。

7、《汇添富理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 12 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

8、本报告期内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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	101,630,813.38	100.00%	76,312.25	100.00%	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	基金交易	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	28,962,460.91	100.00%

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

(1) 基金交易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。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

上交所席位为与增收基金公用席位，本基金本报告期内未新增和减少交易单元。

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	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金 2011 年年度资产净值的公告	管理人网站	2012 年 1 月 4 日
2	汇添富基金管理有限公司关于增加财富里昂证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 1 月 9 日
3	汇添富基金管理有限公司关于增加国海证券为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 1 月 11 日
4	汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2011 年第四季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 1 月 20 日
5	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国建设银行开展的电子渠道申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 2 月 21 日
6	汇添富基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 3 月 14 日

7	汇添富基金管理有限公司关于开通浦发银行借记卡进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 3 月 21 日
8	汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2011 年年度报告	管理人网站	2012 年 3 月 30 日
9	汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2011 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 3 月 30 日
10	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金继续参与中国工商银行个人电子银行申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 3 月 31 日
11	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国泰君安证券开展的自助交易系统申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 4 月 6 日
12	汇添富基金管理有限公司关于开通中信银行借记卡进行网上直销业务的公	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 4 月 11 日
13	汇添富基金管理有限公司关于调整旗下基金在中国建设银行定投申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 4 月 16 日
14	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东吴证券开展的网上交易系统申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 4 月 23 日
15	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东吴证券开展的网上交易系统申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 4 月 23 日
16	汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2012 年第 1 季度报告_	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 4 月 24 日
17	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国农业银行开展的网上银行申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 5 月 2 日
18	汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书（2012 年第 1 号）	管理人网站	2012 年 5 月 11 日
19	汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书摘要（2012 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 5 月 11 日

20	汇添富基金管理有限公司关于增加新时代证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 5 月 14 日
21	汇添富基金管理有限公司关于开通支付宝账户进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 5 月 15 日
22	汇添富基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 6 月 7 日
23	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行为代销机构并参与电子渠道申购和定投基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 6 月 27 日
24	汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与交通银行电子渠道申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012 年 6 月 27 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
- 2、《汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3、《汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

11.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理有限公司

11.3 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。

汇添富基金管理有限公司
2012 年 8 月 28 日