

# 汇添富沪深 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：招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。

基金托管人招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 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
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 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	15
§ 5 托管人报告 .....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
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 .....	16
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 .....	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	16
6.1 资产负债表 .....	16
6.2 利润表 .....	18
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	19
6.4 报表附注 .....	20
§ 7 投资组合报告 .....	43
7.1 期末基金资产组合情况 .....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 .....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
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 .....	53

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§ 8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
§ 9 开放式基金份额变动.....	55
§ 10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§ 12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	添富沪深 300ETF
场内简称	添富 300
基金主代码	515310
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 04 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	52,111,220.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 12 月 25 日

注：扩位证券简称：沪深 300 指数 ETF。

### 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的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用完全复制法，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化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数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	招商银行股份有限公司
信息披露	姓名	李鹏
负责人	联系电话	021-28932888
		张姗
		0755-83077987

电子邮箱	service@99fund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	400-888-9918	95555
传真	021-28932998	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	上海市黄浦区外马路728号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	200010	518040
法定代表人	李文	缪建民

## 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	173,487.39
本期利润	325,130.50
加权平均基金份额本期利润	0.0082
本期加权平均净值利润率	0.73%
本期基金份额净值增长率	0.26%
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	371,939.08
期末可供分配基金份额利润	0.0071
期末基金资产净值	56,490,029.51
期末基金份额净值	1.0840
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	8.40%

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。

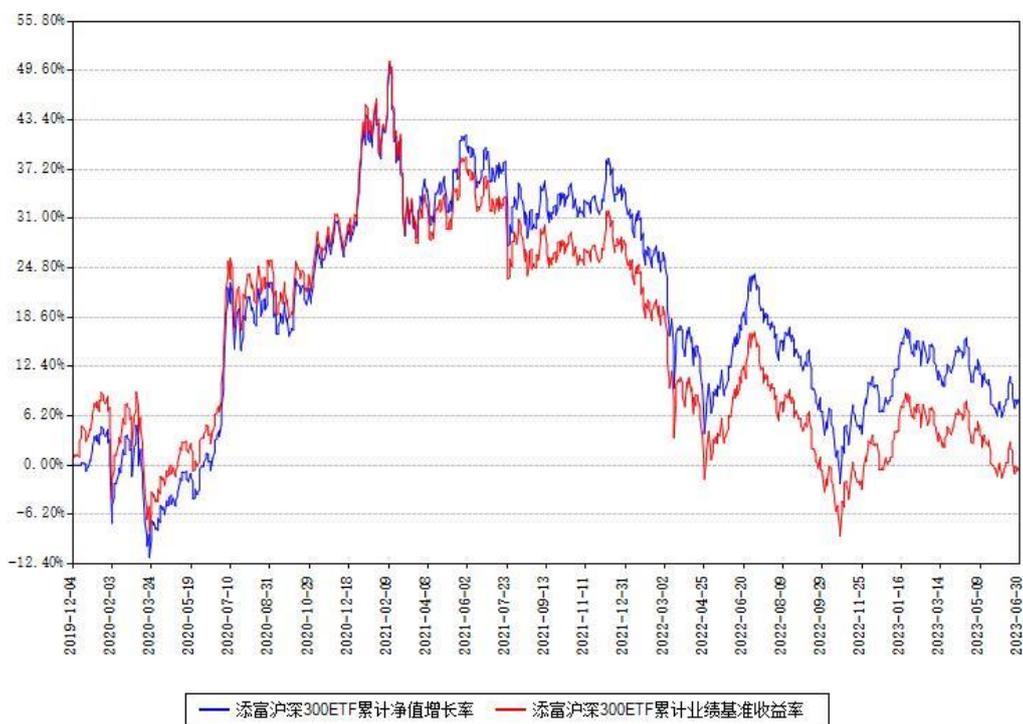
### 3.2 基金净值表现

#### 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	2.10%	0.86%	1.16%	0.87%	0.94%	-0.01%
过去三个月	-4.09%	0.82%	-5.15%	0.83%	1.06%	-0.01%
过去六个月	0.26%	0.83%	-0.75%	0.84%	1.01%	-0.01%
过去一年	-12.40%	0.98%	-14.33%	0.99%	1.93%	-0.01%
过去三年	3.19%	1.18%	-7.72%	1.20%	10.91%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	8.40%	1.21%	-0.22%	1.24%	8.62%	-0.03%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

添富沪深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（2019年12月04日）起6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		
董瑾	本基金的基金经理	2019 年 12 月 04 日		14	国籍：中国。学历：北京大学西方经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 8 月至 2012 年 12 月任国泰基金管理有限公司产品经理助理，2012 年 12 月至 2015 年 9 月任汇添富基金管理股份有限公司产品经理，2015 年 9 月至 2016 年 10 月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017 年

				<p>12月18日至2019年12月31日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017年12月18日至2019年12月31日任中证上海国企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。2019年12月4日至今任汇添富沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019年12月31日至今任汇添富沪深300指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019年12月31日至2023年5月8日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019年12月31日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020年3月5日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基</p>
--	--	--	--	--

				<p>金的基金经理。</p> <p>2021 年 2 月 1 日至今任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 9 日至今任汇添富中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 11 日至 2022 年 5 月 23 日任汇添富中证电池主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 26 日至 2022 年 10 月 11 日任汇添富中证沪港深 500 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 3 月 3 日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月 23 日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

				<p>2022 年 6 月 13 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>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。</p> <p>2022 年 12 月 29 日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p> <p>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。</p> <p>2023 年 2 月 27 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2023 年 4 月 6 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2023 年 4 月 13 日至今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。</p> <p>2023 年 4 月 13 日至今任汇添富中证港</p>
--	--	--	--	--

					<p>股通高股息投资指数发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。</p> <p>2023年5月9日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”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相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

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

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行T检验。对于未通过T

检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 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

根据国家统计局数据，上半年国内生产总值同比增长 5.5%，比一季度加快 1.0 个百分点。其中，全国规模以上工业增加值同比增长 3.8%，服务业增加值同比增长 6.4%，社会消费品零售总额同比增长 8.2%，全国固定资产投资同比增长 3.8%。上半年，经济运行总体上呈恢复态势。分项来看，工业生产有所恢复，消费逐步改善，投资方面基建和制造业仍是主要驱动因素，房地产对于经济增速仍有一定程度的拖累。

继一季度主题投资突出及结构性行情分化之后，二季度市场整体呈现调整态势。风格上比较均衡，主要宽基指数均有一定程度的回调。行业主题方面，数字经济相关的通信、传媒以及偏周期性的电力、金融表现相对较好；而消费、医药和新能源等板块延续调整。

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，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

本基金本报告期基金份额净值增长率为 0.26%。同期业绩比较基准收益率为-0.75%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济有望继续恢复向好。政策方面，6 月国常会指出，针对经济形势的变化，必须采取更加有力的措施，增强发展动能，优化经济结构，推动经济持续回升向好。会议围绕加大宏观政策调控力度、着力扩大有效需求、做强做优实体经济、防范化解重点领域

风险等四个方面,研究提出了一批政策措施。货币政策上,为维护银行体系流动性合理充裕,央行先后调降OMO、SLF、MLF利率10个基点,有望提振市场信心。

随着经济的恢复增长,权益市场有望迎来估值修复。风格上,复苏初期或以价值为主,后续随着行情演绎,成长可能重回主导。行业板块方面,数字经济及科技领域仍然体现出较强的动能。而新能源的基本面呈现企稳改善的态势,经过前期调整,当前估值低于历史中枢,具备一定的配置价值。

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,积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差,实现投资目标。

#### 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:每一基金份额享有同等分配权;本基金的收益分配采用现金分红;本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。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

自2023年1月17日起至2023年3月30日,本基金连续48个工作日基金资产净值低于五千万元。自2023年4月4日起至2023年6月29日,本基金连续57个工作日基金资产净值低于五千万元。自2023年6月30日起至报告期末,本基金未再出现基金资产净值预警

情形。

## § 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：汇添富沪深 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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	536,162.63	900,591.65
结算备付金		12,598.44	33,577.12
存出保证金		14,328.07	5,771.87
交易性金融资产	6.4.7.2	55,704,006.90	51,756,706.81
其中：股票投资		55,704,006.90	51,756,706.81
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		4,527,247.80	2,881,453.23
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		60,794,343.84	55,578,100.68
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		4,219,317.03	2,947,950.95
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,555.46	4,733.17
应付托管费		1,851.85	1,577.70
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	77,589.99	63,054.87
负债合计		4,304,314.33	3,017,316.69
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	52,111,220.00	48,611,220.00
未分配利润	6.4.7.9	4,378,809.51	3,949,563.99
净资产合计		56,490,029.51	52,560,783.99
负债和净资产总计		60,794,343.84	55,578,100.68

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0840 元，基金份额总额 52,111,220.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 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 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
<b>一、营业总收入</b>		<b>386,854.56</b>	<b>-7,868,170.42</b>
1. 利息收入		2,354.57	4,732.44
其中：存款利息收入	6.4.7.10	2,354.57	4,732.44
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）		71,722.86	-13,525,662.18
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-454,720.58	-13,333,615.72
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,139.31	53,444.72
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	-	-390,440.64
股利收益	6.4.7.17	524,304.13	144,949.46
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	151,643.11	5,926,251.01
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	161,134.02	-273,491.69
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>61,724.06</b>	<b>159,636.82</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	33,097.31	28,020.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,032.49	9,340.13
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	0.06
8. 其他费用	6.4.7.21	17,594.26	122,276.27

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		325,130.50	-8,027,807.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		325,130.50	-8,027,807.24
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		325,130.50	-8,027,807.24

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富沪深 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）	48,611,220.00	3,949,563.99	52,560,783.99
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	48,611,220.00	3,949,563.99	52,560,783.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,500,000.00	429,245.52	3,929,245.52
（一）、综合收益总额	-	325,130.50	325,130.50
（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）	3,500,000.00	104,115.02	3,604,115.02
其中：1. 基金申购款	49,000,000.00	5,972,014.04	54,972,014.04
2. 基金赎回款	-45,500,000.00	-5,867,899.02	-51,367,899.02
（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	52,111,220.00	4,378,809.51	56,490,029.51

资产(基金净值)			
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)	157,111,220.00	54,728,848.31	211,840,068.31
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	157,111,220.00	54,728,848.31	211,840,068.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-136,500,000.00	-49,833,820.25	-186,333,820.25
(一)、综合收益总额	-	-8,027,807.24	-8,027,807.24
(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)	-136,500,000.00	-41,806,013.01	-178,306,013.01
其中: 1. 基金申购款	17,500,000.00	2,753,126.97	20,253,126.97
2. 基金赎回款	-154,000,000.00	-44,559,139.98	-198,559,139.98
(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)	20,611,220.00	4,895,028.06	25,506,248.06

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

汇添富沪深 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[2019] 525 号文《关于准予汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由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 2019 年 12 月 4 日生效。首次设立基金募集规模为 276,111,220.00 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（2019）验字第 60466941\_B54 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）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）。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率。

#### 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有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所

得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 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	536,162.63
等于：本金	536,104.28
加：应计利息	58.35
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	536,162.63

##### 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	58,101,591.96	-	55,704,006.90	-2,397,585.06

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	58,101,591.96	-	55,704,006.90	-2,397,585.06

#### 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	14,239.55
其中：交易所市场	14,239.55
银行间市场	-
应付利息	-

应付审计费	59,916.99
应付信息披露费	-
应付指数使用费	3,433.45
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	77,589.99

#### 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	48,611,220.00	48,611,220.00
本期申购	49,000,000.00	49,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-45,500,000.00	-45,500,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	52,111,220.00	52,111,220.00

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	98,136.75	3,851,427.24	3,949,563.99
本期利润	173,487.39	151,643.11	325,130.50
本期基金份额交易产生的变动数	100,314.94	3,800.08	104,115.02
其中：基金申购款	15,560.87	5,956,453.17	5,972,014.04
基金赎回款	84,754.07	-5,952,653.09	-5,867,899.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	371,939.08	4,006,870.43	4,378,809.51

#### 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	1,824.32
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	422.25
其他	108.00
合计	2,354.57

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——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-506,084.65
股票投资收益——赎回差价收入	51,364.07
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-454,720.58

##### 6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	23,429,762.82
减：卖出股票成本总额	23,872,717.02
减：交易费用	63,130.45
买卖股票差价收入	-506,084.65

##### 6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	51,367,899.02
减：现金支付赎回款总额	19,962,365.02
减：赎回股票成本总额	31,354,169.93
减：交易费用	-
赎回差价收入	51,364.07

#### 6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	2.38
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	2,136.93
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,139.31

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,039.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,900.00
减：应计利息总额	2.38
减：交易费用	0.56
买卖债券差价收入	2,136.93

**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	524,304.13
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	524,304.13

#### 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	151,643.11
——股票投资	151,643.11
——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	151,643.11

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	161,134.02
其他	-
合计	161,134.02

#### 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	9,916.99
信息披露费	-
证券出借违约金	-
账户维护费	-

银行费用	1,057.80
指数使用费	6,619.47
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	17,594.26

#### 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
招商银行股份有限公司 (“招商银行”)	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

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	8,478,983.64	17.09	30,892,822.04	25.21
------	--------------	-------	---------------	-------

#### 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	14,039.87	100.00	451,852.31	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	6,115.51	17.09	3,647.00	25.61
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	26,249.35	28.69	2,220.41	38.13

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	33,097.31	28,020.36
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 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、公休日等，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	11,032.49	9,340.13

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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 (%)
东方证券股份有限公司	5,284,420.00	10.14	1,836,020.00	3.78

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
招商银行	536,162.63	1,824.32	669,899.88	2,427.45

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 股)	总金额
				-	-
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日					

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
东方证券承销保荐有限公司	600958	东方证券	原股东优先配售	1,428.00	12,080.88

#### 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

本基金根据基金合同和招募说明书约定的投资策略，按照标的指数的成份股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理人的股东东方证券发行的股票东方证券，和基金托管人招商银行发行的股票招商银行。于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 15,628.00 股，持有招商银行 36,700.00 股。（于上年度可比期间，本基金按照指数权重比例持有东方证券 6,228.00 股，持有招商银行 14,700.00 股。）

#### 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	536,162.63	-	-	-	-	-	536,162.63
结算备付金	12,598.44	-	-	-	-	-	12,598.44
存出保证	14,328.07	-	-	-	-	-	14,328.07

金							
交易性金融资产	-	-	-	-	-	55,704,006.90	55,704,006.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	4,527,247.80	4,527,247.80
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	563,089.14	-	-	-	-	60,231,254.70	60,794,343.84
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	-	-	-	-	-	4,219,317.03	4,219,317.03
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,555.46	5,555.46
应付托管费	-	-	-	-	-	1,851.85	1,851.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	77,589.99	77,589.99
负债总计	-	-	-	-	-	4,304,314.33	4,304,314.33
利率敏感度缺口	563,089.14	-	-	-	-	55,926,940.37	56,490,029.51
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	900,591.65	-	-	-	-	-	900,591.65
结算备付金	33,577.12	-	-	-	-	-	33,577.12
存出保证金	5,771.87	-	-	-	-	-	5,771.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-	51,756,706.81	51,756,706.81
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	2,881,453.23	2,881,453.23
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	939,940.64	-	-	-	-	54,638,160.04	55,578,100.68
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-

债							
衍生 金融 负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 清算 款	-	-	-	-	-	2,947,950.95	2,947,950.95
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	4,733.17	4,733.17
应付 托管 费	-	-	-	-	-	1,577.70	1,577.70
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	-	-	-	-	-	63,054.87	63,054.87
负债 总计	-	-	-	-	-	3,017,316.69	3,017,316.69
利率 敏感	939,940.64	-	-	-	-	51,620,843.35	52,560,783.99

度缺 口							
---------	--	--	--	--	--	--	--

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	55,704,006.90	98.61	51,756,706.81	98.47
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	55,704,006.90	98.61	51,756,706.81	98.47

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	<p>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；</p> <p>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</p>
----	---

	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
	沪深 300 指数上涨 5%	2,786,776.46	2,580,709.43
	沪深 300 指数下跌 5%	-2,786,776.46	-2,580,709.43

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	55,704,006.90
第二层次	-
第三层次	-
合计	55,704,006.90

###### 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	55,704,006.90	91.63
	其中：股票	55,704,006.90	91.63
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	548,761.07	0.90
8	其他各项资产	4,541,575.87	7.47
9	合计	60,794,343.84	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	623,013.80	1.10
B	采矿业	2,187,914.20	3.87
C	制造业	31,715,179.01	56.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,670,304.00	2.96

E	建筑业	1,326,303.35	2.35
F	批发和零售业	188,811.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	1,748,832.20	3.10
H	住宿和餐饮业	59,276.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,658,336.87	4.71
J	金融业	11,256,529.04	19.93
K	房地产业	819,212.00	1.45
L	租赁和商务服务业	524,156.00	0.93
M	科学研究和技术服务业	541,229.28	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	302,806.15	0.54
R	文化、体育和娱乐业	82,104.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	55,704,006.90	98.61

### 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	600519	贵州茅台	2,100	3,551,100.00	6.29
2	300750	宁德时代	7,760	1,775,410.40	3.14
3	601318	中国平安	32,200	1,494,080.00	2.64
4	600036	招商银行	36,700	1,202,292.00	2.13
5	000858	五粮液	5,800	948,706.00	1.68
6	000333	美的集团	14,605	860,526.60	1.52
7	002594	比亚迪	2,700	697,329.00	1.23
8	601166	兴业银行	43,000	672,950.00	1.19
9	600900	长江电力	29,100	641,946.00	1.14
10	600276	恒瑞医药	13,252	634,770.80	1.12

11	601899	紫金矿业	48,800	554,856.00	0.98
12	600887	伊利股份	18,900	535,248.00	0.95
13	600030	中信证券	27,040	534,851.20	0.95
14	300059	东方财富	37,466	532,017.20	0.94
15	601012	隆基绿能	17,948	514,569.16	0.91
16	600309	万华化学	5,600	491,904.00	0.87
17	000651	格力电器	13,300	485,583.00	0.86
18	002475	立讯精密	14,760	478,962.00	0.85
19	601328	交通银行	81,300	471,540.00	0.83
20	002415	海康威视	13,800	456,918.00	0.81
21	000725	京东方 A	111,100	454,399.00	0.80
22	601398	工商银行	89,800	432,836.00	0.77
23	000063	中兴通讯	9,300	423,522.00	0.75
24	300760	迈瑞医疗	1,400	419,720.00	0.74
25	000568	泸州老窖	2,000	419,140.00	0.74
26	601816	京沪高铁	72,700	382,402.00	0.68
27	002230	科大讯飞	5,600	380,576.00	0.67
28	603259	药明康德	6,088	379,343.28	0.67
29	300274	阳光电源	3,100	361,553.00	0.64
30	300124	汇川技术	5,600	359,576.00	0.64
31	600028	中国石化	56,300	358,068.00	0.63
32	601668	中国建筑	62,100	356,454.00	0.63
33	002714	牧原股份	7,972	336,019.80	0.59
34	601288	农业银行	94,500	333,585.00	0.59
35	002352	顺丰控股	7,300	329,157.00	0.58
36	000001	平安银行	28,600	321,178.00	0.57
37	601888	中国中免	2,900	320,537.00	0.57
38	002129	TCL 中环	9,425	312,910.00	0.55
39	000792	盐湖股份	16,100	308,637.00	0.55
40	601088	中国神华	9,900	304,425.00	0.54
41	002142	宁波银行	11,770	297,781.00	0.53
42	601138	工业富联	11,800	297,360.00	0.53
43	688981	中芯国际	5,800	293,016.00	0.52
44	600031	三一重工	17,600	292,688.00	0.52
45	300498	温氏股份	15,640	286,994.00	0.51
46	600436	片仔癀	1,000	286,360.00	0.51
47	002371	北方华创	900	285,885.00	0.51
48	000002	万 科 A	20,300	284,606.00	0.50
49	600016	民生银行	73,600	276,000.00	0.49
50	600406	国电南瑞	11,903	274,959.30	0.49
51	600438	通威股份	7,900	271,049.00	0.48
52	600809	山西汾酒	1,460	270,202.20	0.48
53	600690	海尔智家	11,300	265,324.00	0.47

54	601601	中国太保	10,200	264,996.00	0.47
55	600837	海通证券	28,500	262,770.00	0.47
56	600089	特变电工	11,600	258,564.00	0.46
57	601728	中国电信	45,900	258,417.00	0.46
58	600048	保利发展	19,800	257,994.00	0.46
59	600919	江苏银行	35,060	257,691.00	0.46
60	300015	爱尔眼科	13,713	254,376.15	0.45
61	600000	浦发银行	34,900	252,676.00	0.45
62	600941	中国移动	2,700	251,910.00	0.45
63	601857	中国石油	33,700	251,739.00	0.45
64	603501	韦尔股份	2,545	249,511.80	0.44
65	600050	中国联通	49,300	236,640.00	0.42
66	601390	中国中铁	30,600	231,948.00	0.41
67	601766	中国中车	35,400	230,100.00	0.41
68	600905	三峡能源	42,500	228,225.00	0.40
69	603288	海天味业	4,821	225,863.85	0.40
70	002304	洋河股份	1,700	223,295.00	0.40
71	000938	紫光股份	6,880	219,128.00	0.39
72	600150	中国船舶	6,500	213,915.00	0.38
73	300014	亿纬锂能	3,500	211,750.00	0.37
74	601225	陕西煤业	11,600	211,004.00	0.37
75	601988	中国银行	53,900	210,749.00	0.37
76	002466	天齐锂业	3,000	209,730.00	0.37
77	601688	华泰证券	15,100	207,927.00	0.37
78	002027	分众传媒	29,900	203,619.00	0.36
79	002459	晶澳科技	4,828	201,327.60	0.36
80	000338	潍柴动力	16,100	200,606.00	0.36
81	603986	兆易创新	1,888	200,600.00	0.36
82	600570	恒生电子	4,473	198,109.17	0.35
83	601985	中国核电	28,000	197,400.00	0.35
84	002460	赣锋锂业	3,238	197,388.48	0.35
85	600104	上汽集团	13,700	194,129.00	0.34
86	000625	长安汽车	14,776	191,053.68	0.34
87	688111	金山办公	400	188,888.00	0.33
88	002050	三花智控	6,240	188,822.40	0.33
89	601211	国泰君安	13,400	187,466.00	0.33
90	600111	北方稀土	7,500	179,850.00	0.32
91	601169	北京银行	38,600	178,718.00	0.32
92	601919	中远海控	18,920	177,848.00	0.31
93	002179	中航光电	3,918	177,681.30	0.31
94	002049	紫光国微	1,900	177,175.00	0.31
95	000100	TCL 科技	44,460	175,172.40	0.31
96	603019	中科曙光	3,400	173,060.00	0.31

97	600009	上海机场	3,800	172,596.00	0.31
98	688012	中微半导体设备	1,100	172,095.00	0.30
99	600585	海螺水泥	7,200	170,928.00	0.30
100	601229	上海银行	29,500	169,625.00	0.30
101	600893	航发动力	4,000	169,040.00	0.30
102	601818	光大银行	54,900	168,543.00	0.30
103	600660	福耀玻璃	4,700	168,495.00	0.30
104	603799	华友钴业	3,660	168,030.60	0.30
105	601628	中国人寿	4,800	167,808.00	0.30
106	002812	恩捷股份	1,700	163,795.00	0.29
107	002271	东方雨虹	6,000	163,560.00	0.29
108	002555	三七互娱	4,600	160,448.00	0.28
109	601658	邮储银行	32,800	160,392.00	0.28
110	002920	德赛西威	1,000	155,810.00	0.28
111	300122	智飞生物	3,450	152,490.00	0.27
112	601989	中国重工	31,500	151,830.00	0.27
113	600958	东方证券	15,628	151,591.60	0.27
114	600999	招商证券	10,830	146,963.10	0.26
115	600760	中航沈飞	3,260	146,700.00	0.26
116	000977	浪潮信息	3,000	145,500.00	0.26
117	000661	长春高新	1,014	138,208.20	0.24
118	688008	澜起科技	2,400	137,808.00	0.24
119	002709	天赐材料	3,300	135,927.00	0.24
120	600426	华鲁恒升	4,400	134,772.00	0.24
121	600584	长电科技	4,300	134,031.00	0.24
122	601186	中国铁建	13,600	133,960.00	0.24
123	300896	爱美客	300	133,485.00	0.24
124	600019	宝钢股份	23,600	132,632.00	0.23
125	688599	天合光能	3,100	132,091.00	0.23
126	600745	闻泰科技	2,700	132,030.00	0.23
127	601006	大秦铁路	17,600	130,768.00	0.23
128	002410	广联达	4,020	130,609.80	0.23
129	601600	中国铝业	23,600	129,564.00	0.23
130	000776	广发证券	8,800	129,448.00	0.23
131	600547	山东黄金	5,440	127,731.20	0.23
132	300316	晶盛机电	1,800	127,620.00	0.23
133	002241	歌尔股份	7,100	126,025.00	0.22
134	601377	兴业证券	20,520	125,582.40	0.22
135	600588	用友网络	6,070	124,435.00	0.22
136	300142	沃森生物	4,699	124,288.55	0.22
137	000166	申万宏源	26,600	122,892.00	0.22
137	601360	三六零	9,800	122,892.00	0.22

139	002311	海大集团	2,600	121,784.00	0.22
140	601009	南京银行	15,200	121,600.00	0.22
141	600011	华能国际	13,100	121,306.00	0.21
142	600010	包钢股份	67,400	120,646.00	0.21
143	600196	复星医药	3,900	120,510.00	0.21
144	300408	三环集团	4,100	120,335.00	0.21
145	001979	招商蛇口	9,100	118,573.00	0.21
146	300782	卓胜微	1,220	117,888.60	0.21
147	601669	中国电建	20,500	117,670.00	0.21
148	688036	传音控股	800	117,600.00	0.21
149	000963	华东医药	2,700	117,099.00	0.21
150	601939	建设银行	18,700	117,062.00	0.21
151	300450	先导智能	3,200	115,744.00	0.20
152	000733	振华科技	1,200	115,020.00	0.20
153	601800	中国交建	10,500	114,555.00	0.20
154	600600	青岛啤酒	1,100	113,993.00	0.20
155	603659	璞泰来	2,965	113,322.30	0.20
156	000768	中航西飞	4,200	112,350.00	0.20
157	603993	洛阳钼业	20,900	111,397.00	0.20
158	600886	国投电力	8,800	111,320.00	0.20
159	600085	同仁堂	1,900	109,364.00	0.19
160	000538	云南白药	2,040	107,059.20	0.19
161	300496	中科创达	1,100	105,985.00	0.19
162	002252	上海莱士	14,100	105,891.00	0.19
163	601689	拓普集团	1,300	104,910.00	0.19
164	002493	荣盛石化	8,950	104,178.00	0.18
165	600926	杭州银行	8,800	103,400.00	0.18
166	600015	华夏银行	18,900	102,249.00	0.18
167	600176	中国巨石	7,157	101,343.12	0.18
168	600795	国电电力	26,400	101,112.00	0.18
169	600845	宝信软件	1,960	99,587.60	0.18
170	688396	华润微电子	1,900	99,579.00	0.18
171	002180	纳思达	2,900	99,325.00	0.18
172	000157	中联重科	14,700	99,225.00	0.18
173	601100	恒立液压	1,540	99,068.20	0.18
174	600732	爱旭股份	3,220	99,015.00	0.18
175	000596	古井贡酒	400	98,952.00	0.18
176	600674	川投能源	6,500	97,825.00	0.17
177	600115	中国东航	20,400	97,104.00	0.17
178	300347	泰格医药	1,500	96,810.00	0.17
179	600029	南方航空	16,000	96,480.00	0.17
180	601995	中金公司	2,700	95,904.00	0.17

181	601336	新华保险	2,600	95,602.00	0.17
182	603369	今世缘	1,800	95,040.00	0.17
183	002236	大华股份	4,800	94,800.00	0.17
184	000425	徐工机械	13,800	93,426.00	0.17
185	601788	光大证券	5,800	92,162.00	0.16
186	000301	东方盛虹	7,700	91,014.00	0.16
187	601868	中国能建	38,300	89,622.00	0.16
188	600346	恒力石化	6,200	88,846.00	0.16
189	601117	中国化学	10,700	88,596.00	0.16
190	002202	金风科技	8,300	88,146.00	0.16
191	601633	长城汽车	3,500	88,095.00	0.16
192	300033	同花顺	500	87,640.00	0.16
193	002841	视源股份	1,300	86,892.00	0.15
194	002001	新和成	5,628	86,671.20	0.15
195	603806	福斯特	2,320	86,280.80	0.15
196	601877	正泰电器	3,100	85,715.00	0.15
197	688126	上海硅产业集团	4,100	85,690.00	0.15
198	002074	国轩高科	3,100	85,622.00	0.15
199	688303	大全能源	2,100	84,945.00	0.15
200	600741	华域汽车	4,600	84,916.00	0.15
201	601111	中国国航	10,300	84,872.00	0.15
202	600188	兖矿能源	2,800	83,776.00	0.15
203	601618	中国中冶	21,100	83,767.00	0.15
204	601838	成都银行	6,800	83,028.00	0.15
205	688223	晶科能源	5,900	82,954.00	0.15
206	300413	芒果超媒	2,400	82,104.00	0.15
207	600989	宝丰能源	6,400	80,704.00	0.14
208	000876	新希望	6,900	80,592.00	0.14
209	601901	方正证券	12,100	79,134.00	0.14
210	600460	士兰微	2,600	78,702.00	0.14
211	601615	明阳智能	4,600	77,648.00	0.14
212	603260	合盛硅业	1,100	77,022.00	0.14
213	603392	万泰生物	1,146	76,518.42	0.14
214	000895	双汇发展	3,100	75,919.00	0.13
215	600039	四川路桥	7,660	75,144.60	0.13
216	002736	国信证券	8,600	75,078.00	0.13
217	601066	中信建投	3,100	75,020.00	0.13
218	000786	北新建材	3,000	73,530.00	0.13
219	002648	卫星化学	4,900	73,304.00	0.13
220	600233	圆通速递	5,000	72,800.00	0.13
221	003816	中国广核	23,400	72,774.00	0.13
222	300207	欣旺达	4,400	71,808.00	0.13

223	601607	上海医药	3,200	71,712.00	0.13
224	002007	华兰生物	3,170	71,039.70	0.13
225	002601	龙佰集团	4,300	70,950.00	0.13
226	300433	蓝思科技	5,900	69,384.00	0.12
227	601021	春秋航空	1,200	68,964.00	0.12
228	002821	凯莱英	580	68,358.80	0.12
229	300999	金龙鱼	1,700	67,983.00	0.12
230	300454	深信服	600	67,950.00	0.12
231	600383	金地集团	9,200	66,332.00	0.12
232	002756	永兴材料	1,050	65,740.50	0.12
233	300759	康龙化成	1,700	65,076.00	0.12
234	300661	圣邦股份	780	64,061.40	0.11
235	600332	白云山	2,000	63,760.00	0.11
236	000983	山西焦煤	6,900	62,790.00	0.11
237	601238	广汽集团	5,900	61,478.00	0.11
238	600875	东方电气	3,200	59,680.00	0.11
239	600754	锦江酒店	1,400	59,276.00	0.10
240	600362	江西铜业	3,100	58,838.00	0.10
241	000723	美锦能源	7,700	58,058.00	0.10
242	600918	中泰证券	8,400	58,044.00	0.10
243	601865	福莱特	1,500	57,765.00	0.10
244	601878	浙商证券	5,800	57,304.00	0.10
245	601872	招商轮船	9,800	56,742.00	0.10
246	000408	藏格矿业	2,500	56,425.00	0.10
247	601699	潞安环能	3,400	55,488.00	0.10
248	600132	重庆啤酒	600	55,296.00	0.10
249	600219	南山铝业	18,000	54,360.00	0.10
250	601319	中国人保	9,300	54,312.00	0.10
251	000617	中油资本	7,500	54,225.00	0.10
251	300919	中伟股份	900	54,225.00	0.10
253	300751	迈为股份	320	54,201.60	0.10
254	605117	德业股份	360	53,838.00	0.10
255	601998	中信银行	9,000	53,820.00	0.10
256	603899	晨光股份	1,200	53,568.00	0.09
257	300628	亿联网络	1,520	53,306.40	0.09
258	600803	新奥股份	2,800	53,144.00	0.09
259	300223	北京君正	600	52,986.00	0.09
260	300769	德方纳米	480	52,910.40	0.09
261	000069	华侨城 A	12,000	52,800.00	0.09
262	300763	锦浪科技	500	52,050.00	0.09
263	600884	杉杉股份	3,300	49,962.00	0.09
264	600061	国投资本	6,992	49,783.04	0.09
265	600763	通策医疗	500	48,430.00	0.09

266	600183	生益科技	3,400	48,280.00	0.09
267	300601	康泰生物	1,900	48,241.00	0.09
268	000708	中信特钢	3,000	47,520.00	0.08
269	002938	鹏鼎控股	1,900	46,151.00	0.08
270	603833	欧派家居	480	45,984.00	0.08
271	601881	中国银河	3,900	45,279.00	0.08
272	688363	华熙生物	500	44,580.00	0.08
273	601898	中煤能源	5,100	43,044.00	0.08
274	603290	斯达半导	200	43,040.00	0.08
275	601216	君正集团	10,100	41,410.00	0.07
276	002120	韵达股份	4,320	41,299.20	0.07
277	000877	天山股份	5,000	40,700.00	0.07
278	002064	华峰化学	5,900	40,474.00	0.07
279	601155	新城控股	2,700	38,907.00	0.07
280	603486	科沃斯	500	38,885.00	0.07
281	002414	高德红外	4,967	38,593.59	0.07
282	600025	华能水电	5,400	38,502.00	0.07
283	688005	容百科技	700	37,814.00	0.07
284	600018	上港集团	7,200	37,800.00	0.07
285	603185	弘元绿能	500	37,275.00	0.07
286	601799	星宇股份	300	37,080.00	0.07
287	002916	深南电路	460	34,670.20	0.06
288	600606	绿地控股	12,577	34,586.75	0.06
289	688561	奇安信集团	600	31,086.00	0.06
290	688065	凯赛生物	480	29,884.80	0.05
291	688187	时代电气	700	29,302.00	0.05
292	603195	公牛集团	296	28,433.76	0.05
293	300957	贝泰妮	300	26,664.00	0.05
294	601698	中国卫通	1,300	25,844.00	0.05
295	601808	中海油服	1,700	23,596.00	0.04
296	000800	一汽解放	2,800	23,436.00	0.04
297	601236	红塔证券	2,810	20,934.50	0.04
298	300979	华利集团	400	19,496.00	0.03
299	605499	东鹏饮料	100	17,290.00	0.03
300	001289	龙源电力	300	6,750.00	0.01

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	1,744,216.00	3.32
2	000858	五粮液	1,100,590.00	2.09
3	000333	美的集团	796,593.00	1.52
4	002594	比亚迪	739,232.00	1.41
5	300059	东方财富	594,739.00	1.13
6	002415	海康威视	507,296.00	0.97
7	000651	格力电器	467,405.00	0.89
8	300760	迈瑞医疗	443,640.00	0.84
9	000725	京东方 A	440,937.00	0.84
10	002475	立讯精密	434,181.00	0.83
11	002371	北方华创	407,329.00	0.77
12	002352	顺丰控股	388,423.91	0.74
13	300124	汇川技术	383,907.00	0.73
14	000568	泸州老窖	383,697.00	0.73
15	000001	平安银行	363,067.00	0.69
16	600519	贵州茅台	351,626.00	0.67
17	000792	盐湖股份	345,535.00	0.66
18	002714	牧原股份	344,525.00	0.66
19	300274	阳光电源	333,523.00	0.63
20	002142	宁波银行	327,405.00	0.62

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	1,622,148.00	3.09
2	000858	五粮液	1,046,319.00	1.99
3	000333	美的集团	730,014.00	1.39
4	002594	比亚迪	708,459.00	1.35
5	300059	东方财富	589,272.00	1.12
6	600519	贵州茅台	537,214.00	1.02
7	002415	海康威视	501,477.00	0.95
8	300760	迈瑞医疗	442,556.00	0.84
9	000651	格力电器	428,754.00	0.82
10	002475	立讯精密	405,230.94	0.77

11	000725	京东方 A	401,786.00	0.76
12	002352	顺丰控股	385,212.00	0.73
13	002371	北方华创	384,755.00	0.73
14	300124	汇川技术	370,229.00	0.70
15	000001	平安银行	362,247.00	0.69
16	000568	泸州老窖	353,806.00	0.67
17	000792	盐湖股份	338,079.00	0.64
18	002142	宁波银行	323,820.00	0.62
19	000002	万科 A	322,801.00	0.61
20	002714	牧原股份	317,712.00	0.60

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	26,195,183.93
卖出股票收入（成交）总额	23,429,762.82

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:本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

#### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 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	14,328.07
2	应收清算款	4,527,247.80
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	4,541,575.87

#### 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	户均持有的	持有人结构
------	-------	-------

数（户）	基金份额	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（%）
1,217	42,819.41	28,417,120.00	54.53	23,694,100.00	45.47

## 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	中信建投证券股份有限公司	7,302,800.00	14.01
2	中信证券股份有限公司	6,820,700.00	13.09
3	东方证券股份有限公司	5,284,420.00	10.14
4	李广涛	3,359,600.00	6.45
5	广发证券股份有限公司	3,285,000.00	6.30
6	招商证券股份有限公司	2,542,900.00	4.88
7	方正证券股份有限公司	1,960,500.00	3.76
8	陆雪华	814,600.00	1.56
9	田晨丞	800,000.00	1.54
10	李倩	707,500.00	1.36

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年12月04日） 基金份额总额	276,111,220.00
--------------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	48,611,220.00
本报告期基金总申购份额	49,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	45,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	52,111,220.00

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。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 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。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

### 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 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 (%)	
广发证券	4	41,145,963.11	82.91	29,678.79	82.91	
东方证券	2	8,478,983.64	17.09	6,115.51	17.09	
安信证券	2	-	-	-	-	
财达证券	2	-	-	-	-	
德邦证券	2	-	-	-	-	
东北证券	2	-	-	-	-	
东方财富	2	-	-	-	-	
高盛中国	2	-	-	-	-	
国金证券	2	-	-	-	-	
国泰君安	2	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
海通证券	2	-	-	-	-	
华安证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	1	-	-	-	-	
开源证券	2	-	-	-	-	
民生证券	2	-	-	-	-	
申万宏源证券	2	-	-	-	-	
天风证券	2	-	-	-	-	
招商证券	3	-	-	-	-	
中信建	2	-	-	-	-	

投证券						
中信证 券	2	-	-	-	-	
中原证 券	2	-	-	-	-	

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 (%)
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	14,039.87	100.00	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由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, 同一基金管理人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	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代理券商的公告	上交所, 证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 24 日
3	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
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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金变更扩位证券简称的公告	证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 17 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新产品资料概要	上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 18 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

## § 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

注: 无。

### 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、中国证监会批准汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 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、报告期内汇添富沪深 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](http://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