

汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资 基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 08 月 30 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 2024 年 8 月 28 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 2024 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.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§ 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.....	17
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
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.....	61
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.....	61
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.....	61

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
7.12 投资组合报告附注.....	61
§ 8 基金份额持有人信息.....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
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.....	63
§ 9 开放式基金份额变动.....	63
§ 10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§ 12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

§ 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）	269,111,220.00
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 负责人	姓名	李鹏	张姗
	联系电话	021-28932888	400-61-95555
	电子邮箱	service@99fund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	400-888-9918	400-61-95555	
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(2024 年 01 月 01 日 - 2024 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	3,444,890.71
本期利润	10,981,774.69
加权平均基金份额本期利润	0.0424
本期加权平均净值利润率	4.23%
本期基金份额净值增长率	1.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,284,515.20
期末可供分配基金份额利润	-0.0085

期末基金资产净值	267,694,665.62
期末基金份额净值	0.9947
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-0.53%

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	-2.65%	0.47%	-3.30%	0.48%	0.65%	-0.01%
过去三个月	-1.22%	0.75%	-2.14%	0.76%	0.92%	-0.01%
过去六个月	1.71%	0.89%	0.89%	0.90%	0.82%	-0.01%
过去一年	-8.24%	0.87%	-9.91%	0.87%	1.67%	0.00%
过去三年	-28.61%	1.03%	-33.74%	1.05%	5.13%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	-0.53%	1.15%	-10.11%	1.17%	9.58%	-0.02%

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

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。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于2005年2月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国及新加坡设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司、汇添富资产管理（新加坡）有限公司、汇添富投资管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、

国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2024 上半年，汇添富基金新成立 22 只公开募集证券投资基金，包括 12 只股票型基金、9 只债券型基金、1 只混合型基金。截至 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 336 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	-	15	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

					<p>300 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。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 2023 年 8 月 29 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>金联接基金的基金经理。2020年3月5日至2023年8月29日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金的基金经理。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。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</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>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。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。2022 年 7 月 13 日至 2023 年 11 月 28 日任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 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。2023 年 1 月 16 日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 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。2023 年 4 月 6 日至今</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 5 月 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。2023 年 8 月 23 日至今任汇添富中证沪港深消费龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 13 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 24 日至今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 6 月 12 日至</p>
--	--	--	--	--	--

					今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种,以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

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

对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,

进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 6 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国家统计局数据显示，2024 年上半年 GDP 同比增长 5.0%。分项来看，社会消费品零售总额同比增长 3.7%；固定资产投资同比增长 3.9%；货物进出口总额同比增长 6.1%。国民经济运行总体平稳，稳中有进，生产稳定增长，需求持续恢复。

上半年权益市场以震荡行情为主。风格上来看，大中盘表现优于小微盘，小微盘股票波动程度较大；价值、红利优于成长。行业主题方面，能源、有色、银行、电力等行业表现较为稳定，相对于市场取得了较高的超额收益；多数行业仍延续调整。

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 1.71%。同期业绩比较基准收益率为 0.89%。

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，党的二十届三中全会将对进一步全面深化改革、推进中国式现代化作出战略部署。随着宏观政策不断落地显效，国内经济有望实现稳健高质量增长。权益市场已具备较高的性价比，随着经济环境的持续改善，有望迎来修复行情。

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，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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合规守信、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：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	4,322,739.11	1,935,613.97
结算备付金		28,783.85	53,348.58
存出保证金		38,177.11	17,979.19
交易性金融资产	6.4.7.2	266,175,278.57	125,776,798.76
其中：股票投资		266,175,278.57	125,776,798.76
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		-	8,840.50

应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		270,564,978.64	127,792,581.00
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,669,506.26	1,297,143.16
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		33,613.75	14,858.78
应付托管费		11,204.58	4,952.92
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	155,988.43	204,935.13
负债合计		2,870,313.02	1,521,889.99
净资产:			
实收基金	6.4.7.8	269,111,220.00	129,111,220.00
未分配利润	6.4.7.9	-1,416,554.38	-2,840,528.99
净资产合计		267,694,665.62	126,270,691.01
负债和净资产总计		270,564,978.64	127,792,581.00

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9947 元，基金份额总额 269,111,220.00 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：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日 至2024年06月30 日	上年度可比期间 2023年01月01日 至2023年06月30 日
一、营业总收入		11,397,679.68	386,854.56
1. 利息收入		4,687.26	2,354.57
其中：存款利息收入	6.4.7.10	4,687.26	2,354.57

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）		3,846,463.68	71,722.86
其中：股票投资收益	6.4.7.11	755,602.96	-454,720.58
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	2,139.31
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	3,090,860.72	524,304.13
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,536,883.98	151,643.11
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	9,644.76	161,134.02
减：二、营业总支出		415,904.99	61,724.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	196,506.01	33,097.31
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	65,501.98	11,032.49
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.21	153,897.00	17,594.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,981,774.69	325,130.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,981,774.69	325,130.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,981,774.69	325,130.50

6.3 净资产变动表

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：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	129,111,220.00	-2,840,528.99	126,270,691.01
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	129,111,220.00	-2,840,528.99	126,270,691.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	140,000,000.00	1,423,974.61	141,423,974.61
（一）、综合收益总额	-	10,981,774.69	10,981,774.69
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	140,000,000.00	-9,557,800.08	130,442,199.92
其中：1. 基金申购款	248,500,000.00	-9,183,551.15	239,316,448.85
2. 基金赎回款	-108,500,000.00	-374,248.93	-108,874,248.93
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	269,111,220.00	-1,416,554.38	267,694,665.62
项目	上年度可比期间		
	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	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	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	-	325,130.50	325,130.50

益总额			
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	52,111,220.00	4,378,809.51	56,490,029.51

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>张晖</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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3%调整为 1%；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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

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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	4,322,739.11
等于：本金	4,322,465.37
加：应计利息	273.74
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,322,739.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	266,462,928.47	-	266,175,278.57	-287,649.90
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		266,462,928.47	-	266,175,278.57	-287,649.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	38,939.19
其中：交易所市场	38,939.19
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	22,376.90
应付信息披露费	59,672.34

应付指数使用费	35,000.00
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
其他	-
合计	155,988.43

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	129,111,220.00	129,111,220.00
本期申购	248,500,000.00	248,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-108,500,000.00	-108,500,000.00
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	269,111,220.00	269,111,220.00

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
上年度末	-2,457,975.79	-382,553.20	-2,840,528.99
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-2,457,975.79	-382,553.20	-2,840,528.99
本期利润	3,444,890.71	7,536,883.98	10,981,774.69
本期基金份额交易产生的变动数	-3,271,430.12	-6,286,369.96	-9,557,800.08
其中：基金申购款	-5,450,871.28	-3,732,679.87	-9,183,551.15
基金赎回款	2,179,441.16	-2,553,690.09	-374,248.93
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-2,284,515.20	867,960.82	-1,416,554.38
-----	---------------	------------	---------------

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入		2,890.12
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		1,520.17
其他		276.97
合计		4,687.26

注：“其他”为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	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-1,140,287.11
股票投资收益——赎回差价收入		1,895,890.07
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		755,602.96

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	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
卖出股票成交总额		62,477,685.13
减：卖出股票成本总额		63,450,930.50
减：交易费用		167,041.74
买卖股票差价收入		-1,140,287.11

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	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
赎回基金份额对价总额		108,874,248.93
减：现金支付赎回款总额		36,324,314.93

减：赎回股票成本总额	70,654,043.93
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,895,890.07

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

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,090,860.72
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	3,090,860.72

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	7,536,883.98
——股票投资	7,536,883.98
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	7,536,883.98

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	9,644.76
其他	-
合计	9,644.76

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
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	1,847.76
指数使用费	70,000.00
持有人大会-公证	-

费	
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	-
合计	153,897.00

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

根据《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《基金管理公司子公司管理规定》等法律法规的有关规定，经中国证券监督管理委员会同意，汇添富基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）已受让汇添富资本管理有限公司持有的汇添富投资管理有限公司（以下简称“汇添富投资”）全部股权。汇添富投资已由本公司的“全资子公司的全资子公司”变更为“全资子公司”。

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	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日
------	--------------------------------	--------------------------

称	月 30 日		至 2023 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	51,050,609.89	30.07	8,478,983.64	17.09

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	37,568.09	30.07	17,423.74	44.75
关联方名称	上年度可比期间 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

注：上述佣金的计算方式按相关协议约定的佣金率计算。上述佣金与应支付非关联方交易佣金的计算方式、佣金计算比率不存在差异，具有公允性。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（被动股票型基金不适用）。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	196,506.01	33,097.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	129.26	-
应支付基金管理人的净管理费	196,376.75	33,097.31

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。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	65,501.98	11,032.49

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 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 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	3,048,920.00	1.13	5,657,920.00	4.38

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	4,322,739.11	2,890.12	536,162.63	1,824.32

行				
---	--	--	--	--

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

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 78,428.00 股，持有招商银行 185,500.00 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 15,628.00 股，持有招商银行 36,700.00 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（2024 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 2024 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 2024 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 2024 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同责任，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 2024 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月- 1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
货币 资金	4,322,739.11	-	-	-	-	-	4,322,739.11
结算 备付 金	28,783.85	-	-	-	-	-	28,783.85
存出 保证 金	38,177.11	-	-	-	-	-	38,177.11

交易性金融资产	-	-	-	-	-	266,175,278.57	266,175,278.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,389,700.07	-	-	-	-	266,175,278.57	270,564,978.64
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	-	-	-	-	-	2,669,506.26	2,669,506.26
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	33,613.75	33,613.75
应付托管费	-	-	-	-	-	11,204.58	11,204.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	155,988.43	155,988.43
负债总计	-	-	-	-	-	2,870,313.02	2,870,313.02
利率敏感度缺口	4,389,700.07	-	-	-	-	263,304,965.55	267,694,665.62
上年度末2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

货币资金	1,935,613.97	-	-	-	-	-	1,935,613.97
结算备付金	53,348.58	-	-	-	-	-	53,348.58
存出保证金	17,979.19	-	-	-	-	-	17,979.19
交易性金融资产	-	-	-	-	-	125,776,798.76	125,776,798.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	8,840.50	8,840.50
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,006,941.74	-	-	-	-	125,785,639.26	127,792,581.00
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	-	-	-	-	-	1,297,143.16	1,297,143.16
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,858.78	14,858.78
应付托管费	-	-	-	-	-	4,952.92	4,952.92
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	-	-	-	-	-	204,935.13	204,935.13
负债总计	-	-	-	-	-	1,521,889.99	1,521,889.99
利率敏感度缺	2,006,941.74	-	-	-	-	124,263,749.27	126,270,691.01

□							
---	--	--	--	--	--	--	--

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券(不含可转换债券及可交换债券)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 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	266,175,278.57	99.43	125,776,798.76	99.61
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	266,175,278.57	99.43	125,776,798.76	99.61

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</p>
----	--

	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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数 上涨 5%	13,289,586.51	6,249,472.41
	沪深 300 指数 下跌 5%	-13,289,586.51	-6,249,472.41

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 2024 年 06 月 30 日
第一层次	266,175,278.57
第二层次	-
第三层次	-
合计	266,175,278.57

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市

场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4.8 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”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	266,175,278.57	98.38
	其中：股票	266,175,278.57	98.38
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	4,351,522.96	1.61
8	其他各项资产	38,177.11	0.01
9	合计	270,564,978.64	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	3,364,844.00	1.26
B	采矿业	16,221,728.20	6.06
C	制造业	138,653,236.70	51.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,496,597.00	4.67
E	建筑业	5,956,242.40	2.23
F	批发和零售业	686,229.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	9,976,070.80	3.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,982,295.13	4.48
J	金融业	59,419,946.46	22.20
K	房地产业	2,449,080.00	0.91
L	租赁和商务服务业	2,136,482.00	0.80
M	科学研究和技术服务业	2,111,024.72	0.79
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	721,502.16	0.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	266,175,278.57	99.43

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	600519	贵州茅台	9,400	13,793,466.00	5.15
2	300750	宁德时代	39,560	7,121,986.80	2.66
3	601318	中国平安	161,300	6,671,368.00	2.49
4	600036	招商银行	185,500	6,342,245.00	2.37
5	600900	长江电力	183,400	5,303,928.00	1.98
6	000333	美的集团	73,205	4,721,722.50	1.76
7	601899	紫金矿业	246,800	4,336,276.00	1.62
8	601166	兴业银行	218,000	3,841,160.00	1.43
9	000858	五粮液	29,100	3,725,964.00	1.39
10	002594	比亚迪	13,600	3,403,400.00	1.27
11	601328	交通银行	411,900	3,076,893.00	1.15
12	601398	工商银行	525,400	2,994,780.00	1.12
13	002475	立讯精密	75,360	2,962,401.60	1.11
14	600030	中信证券	146,340	2,667,778.20	1.00
15	000651	格力电器	67,600	2,651,272.00	0.99
16	300760	迈瑞医疗	9,100	2,647,281.00	0.99
17	600276	恒瑞医药	66,952	2,574,973.92	0.96
18	600887	伊利股份	95,300	2,462,552.00	0.92
19	600309	万华化学	28,300	2,288,338.00	0.85
20	000725	京东方A	553,600	2,264,224.00	0.85
21	601088	中国神华	49,400	2,191,878.00	0.82
22	601288	农业银行	478,700	2,087,132.00	0.78

23	300059	东方财 富	189,266	1,998,648.96	0.75
24	601816	京沪高 铁	368,000	1,976,160.00	0.74
25	300308	中际旭 创	13,520	1,864,137.60	0.70
26	002714	牧原股 份	40,972	1,786,379.20	0.67
27	601857	中国石 油	169,800	1,752,336.00	0.65
28	002415	海康威 视	55,900	1,727,869.00	0.65
29	601668	中国建 筑	311,800	1,655,658.00	0.62
30	600919	江苏银 行	220,160	1,635,788.80	0.61
31	601138	工业富 联	59,600	1,633,040.00	0.61
32	600690	海尔智 家	56,700	1,609,146.00	0.60
33	000568	泸州老 窖	11,100	1,592,739.00	0.59
34	300498	温氏股 份	79,640	1,578,464.80	0.59
35	600809	山西汾 酒	7,360	1,552,076.80	0.58
36	002371	北方华 创	4,800	1,535,472.00	0.57
37	601985	中国核 电	141,500	1,508,390.00	0.56
38	600406	国电南 瑞	60,203	1,502,666.88	0.56
39	601225	陕西煤 业	58,200	1,499,814.00	0.56
40	603259	药明康 德	37,888	1,484,830.72	0.55
41	601919	中远海 控	95,720	1,482,702.80	0.55
42	000001	平安银 行	145,400	1,475,810.00	0.55
43	600031	三一重 工	89,000	1,468,500.00	0.55
44	601988	中国银 行	315,600	1,458,072.00	0.54

45	600941	中国移动	13,500	1,451,250.00	0.54
46	600000	浦发银行	175,900	1,447,657.00	0.54
47	300124	汇川技术	28,100	1,441,530.00	0.54
48	601728	中国电信	232,700	1,431,105.00	0.53
49	601601	中国太保	51,300	1,429,218.00	0.53
50	000792	盐湖股份	81,400	1,420,430.00	0.53
51	600028	中国石化	218,800	1,382,816.00	0.52
52	601766	中国中车	182,400	1,369,824.00	0.51
53	688981	中芯国际	29,600	1,364,560.00	0.51
54	600150	中国船舶	33,500	1,363,785.00	0.51
55	300274	阳光电源	21,800	1,352,254.00	0.51
56	600050	中国联通	285,700	1,342,790.00	0.50
57	000063	中兴通讯	47,800	1,336,966.00	0.50
58	000338	潍柴动力	81,300	1,320,312.00	0.49
59	002352	顺丰控股	36,700	1,309,823.00	0.49
60	601169	北京银行	221,800	1,295,312.00	0.48
61	603501	韦尔股份	12,845	1,276,407.65	0.48
62	601012	隆基绿能	90,848	1,273,688.96	0.48
63	600837	海通证券	144,600	1,237,776.00	0.46
64	000100	TCL 科技	281,760	1,217,203.20	0.45
65	600016	民生银行	319,000	1,209,010.00	0.45
66	002230	科大讯飞	27,800	1,194,010.00	0.45

67	600660	福耀玻璃	24,000	1,149,600.00	0.43
68	002142	宁波银行	49,370	1,089,102.20	0.41
69	601229	上海银行	149,000	1,081,740.00	0.40
70	600089	特变电工	75,700	1,049,959.00	0.39
71	600938	中国海油	31,400	1,036,200.00	0.39
72	601390	中国中铁	154,100	1,004,732.00	0.38
73	000625	长安汽车	74,476	1,000,212.68	0.37
74	688041	海光信息	13,919	978,784.08	0.37
75	600104	上汽集团	69,400	961,884.00	0.36
76	603986	兆易创新	9,988	955,052.56	0.36
77	600436	片仔癀	4,600	952,982.00	0.36
78	601688	华泰证券	76,800	951,552.00	0.36
79	601006	大秦铁路	131,800	943,688.00	0.35
80	600048	保利发展	107,700	943,452.00	0.35
81	600905	三峡能源	214,800	936,528.00	0.35
82	688012	中微半导体设备	6,600	932,316.00	0.35
83	002027	分众传媒	151,800	919,908.00	0.34
84	601211	国泰君安	67,500	914,625.00	0.34
85	601888	中国中免	14,600	912,354.00	0.34
86	603019	中科曙光	21,900	908,850.00	0.34
87	601600	中国铝业	119,100	908,733.00	0.34
88	603993	洛阳钼业	106,000	901,000.00	0.34

89	601818	光大银行	278,500	882,845.00	0.33
90	600019	宝钢股份	132,500	881,125.00	0.33
91	603288	海天味业	25,021	862,473.87	0.32
92	600585	海螺水泥	36,100	851,599.00	0.32
93	601658	邮储银行	166,600	844,662.00	0.32
94	601989	中国重工	170,700	841,551.00	0.31
95	600886	国投电力	44,700	815,328.00	0.30
96	601009	南京银行	77,600	806,264.00	0.30
97	600795	国电电力	133,800	801,462.00	0.30
98	688008	澜起科技	13,800	788,808.00	0.29
99	600999	招商证券	55,630	773,813.30	0.29
100	688111	金山办公	3,400	773,500.00	0.29
101	601628	中国人寿	24,900	773,145.00	0.29
102	600438	通威股份	40,400	772,044.00	0.29
103	000938	紫光股份	34,280	766,158.00	0.29
104	000425	徐工机械	106,100	758,615.00	0.28
105	601939	建设银行	100,600	744,440.00	0.28
106	600547	山东黄金	27,140	743,093.20	0.28
107	300014	亿纬锂能	18,400	734,528.00	0.27
108	600893	航发动力	20,000	731,000.00	0.27
109	002304	洋河股份	9,000	726,660.00	0.27
110	002179	中航光电	19,018	723,634.90	0.27

111	601669	中国电建	129,300	722,787.00	0.27
112	300015	爱尔眼科	69,913	721,502.16	0.27
113	000002	万科A	101,900	706,167.00	0.26
114	002241	歌尔股份	35,800	698,458.00	0.26
115	600926	杭州银行	53,400	696,870.00	0.26
116	000538	云南白药	13,440	687,456.00	0.26
117	600584	长电科技	21,500	681,765.00	0.25
118	600760	中航沈飞	16,560	664,056.00	0.25
119	600111	北方稀土	37,900	651,880.00	0.24
120	600489	中金黄金	43,700	646,760.00	0.24
121	002050	三花智控	33,540	639,943.20	0.24
122	600011	华能国际	66,000	634,920.00	0.24
123	002252	上海莱士	79,800	624,036.00	0.23
124	601916	浙商银行	225,700	622,932.00	0.23
125	600015	华夏银行	95,200	609,280.00	0.23
126	600009	上海机场	18,600	599,850.00	0.22
127	600958	东方证券	78,428	596,052.80	0.22
128	688256	寒武纪科技	3,000	596,010.00	0.22
129	600426	华鲁恒升	22,300	594,072.00	0.22
130	601186	中国铁建	68,800	589,616.00	0.22
131	002311	海大集团	12,500	588,125.00	0.22
132	300408	三环集团	20,100	586,719.00	0.22

133	000166	申万宏源	135,300	583,143.00	0.22
134	601901	方正证券	74,100	572,793.00	0.21
135	600989	宝丰能源	33,000	571,890.00	0.21
136	000157	中联重科	74,400	571,392.00	0.21
137	000977	浪潮信息	15,400	560,098.00	0.21
138	600674	川投能源	29,200	547,500.00	0.20
139	003816	中国广核	118,000	546,340.00	0.20
140	300433	蓝思科技	29,900	545,675.00	0.20
141	000776	广发证券	44,400	540,348.00	0.20
142	002049	紫光国微	10,200	536,520.00	0.20
143	002001	新和成	27,828	534,297.60	0.20
144	688271	联影医疗	4,800	526,560.00	0.20
145	688036	传音控股	6,860	525,064.40	0.20
146	601377	兴业证券	103,720	524,823.20	0.20
147	601111	中国国航	69,800	515,124.00	0.19
148	600115	中国东航	128,000	513,280.00	0.19
149	000596	古井贡酒	2,400	506,568.00	0.19
150	000768	中航西飞	20,900	502,227.00	0.19
151	300122	智飞生物	17,850	500,335.50	0.19
152	002460	赣锋锂业	16,938	485,273.70	0.18
153	001979	招商蛇口	54,300	477,297.00	0.18
154	600029	南方航空	80,800	475,912.00	0.18

155	601800	中国交建	53,200	475,608.00	0.18
156	600010	包钢股份	339,500	475,300.00	0.18
157	601633	长城汽车	18,600	470,580.00	0.18
158	600188	兖矿能源	20,700	470,511.00	0.18
159	002601	龙佰集团	25,000	464,250.00	0.17
160	002466	天齐锂业	15,500	463,605.00	0.17
161	002236	大华股份	29,700	459,162.00	0.17
162	601117	中国化学	55,100	454,024.00	0.17
163	002648	卫星化学	25,200	453,096.00	0.17
164	000661	长春高新	4,914	450,957.78	0.17
165	000786	北新建材	15,200	450,832.00	0.17
166	603799	华友钴业	20,360	450,566.80	0.17
167	002493	荣盛石化	45,650	440,979.00	0.16
168	600346	恒力石化	31,600	440,820.00	0.16
169	000983	山西焦煤	42,700	440,237.00	0.16
170	300782	卓胜微	5,620	436,898.80	0.16
171	603369	今世缘	9,400	434,280.00	0.16
172	600372	中航机载	36,200	433,314.00	0.16
173	601838	成都银行	28,500	432,915.00	0.16
174	600161	天坛生物	17,720	432,368.00	0.16
175	600023	浙能电力	60,200	428,022.00	0.16
176	601788	光大证券	29,200	426,904.00	0.16
177	688223	晶科能	60,000	426,000.00	0.16

		源			
178	000807	云铝股份	31,200	421,512.00	0.16
179	600196	复星医药	19,000	420,660.00	0.16
180	300418	昆仑万维	13,000	419,120.00	0.16
181	002129	TCL 中环	48,325	418,011.25	0.16
182	600845	宝信软件	12,979	414,419.47	0.15
183	002938	鹏鼎控股	10,400	413,504.00	0.15
184	601872	招商轮船	48,900	413,205.00	0.15
185	601868	中国能建	194,800	412,976.00	0.15
186	300661	圣邦股份	4,980	412,244.40	0.15
187	601021	春秋航空	7,300	411,209.00	0.15
188	601360	三六零	53,400	410,112.00	0.15
189	600233	圆通速递	25,800	403,770.00	0.15
190	600570	恒生电子	22,773	402,171.18	0.15
191	600219	南山铝业	105,000	400,050.00	0.15
192	600176	中国巨石	36,157	399,534.85	0.15
193	600085	同仁堂	10,300	393,563.00	0.15
194	600600	青岛啤酒	5,400	392,958.00	0.15
195	002180	纳思达	14,800	391,016.00	0.15
196	601995	中金公司	13,200	390,852.00	0.15
197	605499	东鹏饮料	1,800	388,350.00	0.15
198	600741	华域汽车	23,600	386,568.00	0.14
199	300896	爱美客	2,220	382,062.00	0.14
200	300347	泰格医药	7,800	379,080.00	0.14
201	603392	万泰生	5,746	378,546.48	0.14

		物			
202	601066	中信建投	19,600	377,104.00	0.14
203	002736	国信证券	43,200	375,408.00	0.14
204	601336	新华保险	12,500	375,375.00	0.14
205	601689	拓普集团	7,000	375,270.00	0.14
206	601100	恒立液压	8,040	374,503.20	0.14
207	002271	东方雨虹	30,300	373,902.00	0.14
208	600183	生益科技	17,700	372,762.00	0.14
209	000895	双汇发展	15,600	370,812.00	0.14
210	600745	闻泰科技	13,000	367,250.00	0.14
211	000963	华东医药	13,200	367,092.00	0.14
212	600362	江西铜业	15,500	367,040.00	0.14
213	002920	德赛西威	4,200	365,778.00	0.14
214	001965	招商公路	30,600	362,916.00	0.14
215	601881	中国银河	32,600	354,036.00	0.13
216	600027	华电国际	50,900	353,246.00	0.13
217	601898	中煤能源	27,500	343,200.00	0.13
218	688126	上海硅产业集团	24,681	340,844.61	0.13
219	300033	同花顺	3,200	331,840.00	0.12
220	002459	晶澳科技	29,628	331,833.60	0.12
221	601618	中国中冶	106,800	331,080.00	0.12
222	600026	中远海能	20,900	326,249.00	0.12

223	000999	华润三九	7,640	325,311.20	0.12
224	601699	潞安环能	17,900	324,527.00	0.12
225	002916	深南电路	3,060	323,656.20	0.12
226	600515	海南机场	102,600	322,164.00	0.12
227	601607	上海医药	16,700	319,137.00	0.12
228	300832	新产业	4,700	316,968.00	0.12
229	000301	东方盛虹	39,500	314,815.00	0.12
230	601878	浙商证券	29,100	311,952.00	0.12
231	000876	新希望	33,900	309,846.00	0.12
232	600039	四川路桥	39,260	309,761.40	0.12
233	601998	中信银行	46,200	309,540.00	0.12
234	600332	白云山	10,500	307,965.00	0.12
235	601877	正泰电器	16,100	306,866.00	0.11
236	600588	用友网络	30,670	306,700.00	0.11
237	600875	东方电气	16,600	306,270.00	0.11
238	002074	国轩高科	15,900	304,485.00	0.11
239	600415	小商品城	41,000	304,220.00	0.11
240	002555	三七互娱	23,300	304,065.00	0.11
241	002709	天赐材料	17,300	303,788.00	0.11
242	688396	华润微电子	8,052	301,466.88	0.11
243	600025	华能水电	27,100	292,138.00	0.11
244	600803	新奥股份	13,900	289,120.00	0.11
245	000408	藏格矿	11,900	286,433.00	0.11

		业			
246	300223	北京君正	5,100	282,744.00	0.11
247	300316	晶盛机电	9,800	281,554.00	0.11
248	300628	亿联网络	7,620	280,187.40	0.10
249	002812	恩捷股份	8,800	278,520.00	0.10
250	688599	天合光能	16,346	276,574.32	0.10
251	300142	沃森生物	23,999	273,108.62	0.10
252	300450	先导智能	16,400	272,732.00	0.10
253	600460	士兰微	15,000	262,650.00	0.10
254	605117	德业股份	3,524	261,974.16	0.10
255	002007	华兰生物	16,470	260,061.30	0.10
256	601238	广汽集团	33,100	256,194.00	0.10
257	300496	中科创达	5,600	255,304.00	0.10
258	603260	合盛硅业	5,300	247,563.00	0.09
259	300759	康龙化成	13,300	247,114.00	0.09
260	301269	华大九天	3,200	246,560.00	0.09
261	601319	中国人保	47,800	246,170.00	0.09
262	300999	金龙鱼	8,900	243,415.00	0.09
263	600018	上港集团	41,900	242,182.00	0.09
264	300751	迈为股份	2,020	241,349.60	0.09
265	000733	振华科技	5,800	240,874.00	0.09
266	600918	中泰证券	41,900	237,573.00	0.09
267	002821	凯莱英	3,580	235,564.00	0.09
268	601799	星宇股	2,100	235,284.00	0.09

		份			
269	300413	芒果超媒	11,200	234,080.00	0.09
270	688009	中国通号	39,000	234,000.00	0.09
271	603806	福斯特	15,628	229,731.60	0.09
272	601865	福莱特	11,400	229,140.00	0.09
273	603659	璞泰来	15,965	225,585.45	0.08
274	603195	公牛集团	2,894	223,185.28	0.08
275	600061	国投资本	38,692	218,609.80	0.08
276	600132	重庆啤酒	3,600	218,520.00	0.08
277	300919	中伟股份	7,040	218,169.60	0.08
278	000617	中油资本	38,100	210,312.00	0.08
279	601059	信达证券	14,600	207,466.00	0.08
280	000708	中信特钢	15,100	204,907.00	0.08
281	688303	大全能源	9,800	199,822.00	0.07
282	688187	时代电气	3,900	192,582.00	0.07
283	002410	广联达	20,020	191,791.60	0.07
284	002603	以岭药业	12,500	191,625.00	0.07
285	300454	深信服	3,700	186,961.00	0.07
286	002841	视源股份	6,300	186,039.00	0.07
287	300442	润泽科技	7,700	184,415.00	0.07
288	603899	晨光股份	5,600	175,168.00	0.07
289	688363	华熙生物	2,900	164,053.00	0.06
290	601808	中海油服	8,900	153,080.00	0.06
291	600732	爱旭股份	16,420	148,601.00	0.06
292	603833	欧派家	2,680	143,540.80	0.05

		居			
293	601236	红塔证券	21,310	136,810.20	0.05
294	601698	中国卫通	9,600	135,264.00	0.05
295	300979	华利集团	2,200	133,870.00	0.05
296	300957	贝泰妮	2,500	120,800.00	0.05
297	000800	一汽解放	14,100	110,403.00	0.04
298	688082	盛美上海半导体	1,300	109,863.00	0.04
299	603296	华勤技术	1,400	77,322.00	0.03
300	001289	龙源电力	2,300	39,675.00	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	6,040,741.00	4.78
2	000333	美的集团	4,355,835.00	3.45
3	000858	五粮液	3,867,128.00	3.06
4	002594	比亚迪	2,788,556.00	2.21
5	300760	迈瑞医疗	2,415,399.00	1.91
6	002371	北方华创	2,380,927.00	1.89
7	000651	格力电器	2,361,449.00	1.87
8	300059	东方财富	2,348,339.78	1.86
9	600519	贵州茅台	2,181,243.00	1.73
10	002475	立讯精密	2,143,442.00	1.70
11	000725	京东方 A	2,055,302.00	1.63
12	300124	汇川技术	1,793,534.00	1.42
13	002415	海康威视	1,723,750.00	1.37
14	000568	泸州老窖	1,568,858.00	1.24

15	002714	牧原股份	1,446,247.00	1.15
16	300498	温氏股份	1,435,591.00	1.14
17	002352	顺丰控股	1,354,127.00	1.07
18	000001	平安银行	1,327,106.00	1.05
19	300274	阳光电源	1,281,436.00	1.01
20	002230	科大讯飞	1,260,661.00	1.00

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	7,146,661.00	5.66
2	300750	宁德时代	2,952,453.00	2.34
3	000333	美的集团	2,210,285.00	1.75
4	000858	五粮液	1,967,192.00	1.56
5	002371	北方华创	1,634,266.92	1.29
6	002594	比亚迪	1,584,019.50	1.25
7	000651	格力电器	1,164,129.04	0.92
8	300059	东方财富	1,042,814.00	0.83
9	300760	迈瑞医疗	1,014,088.00	0.80
10	000725	京东方 A	1,005,630.00	0.80
11	002475	立讯精密	990,531.00	0.78
12	300124	汇川技术	986,545.00	0.78
13	002142	宁波银行	803,702.00	0.64
14	002415	海康威视	761,225.00	0.60
15	000568	泸州老窖	726,379.00	0.58
16	002714	牧原股份	707,770.00	0.56
17	002230	科大讯飞	673,599.00	0.53
18	300308	中际旭创	651,149.20	0.52
19	300498	温氏股份	644,760.00	0.51
20	000001	平安银行	642,897.00	0.51

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	107,269,509.13
卖出股票收入（成交）总额	62,477,685.13

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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	38,177.11
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,177.11

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
3,384	79,524.59	143,581,120.00	53.35	125,530,100.00	46.65

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	汇添富基金-中国人寿保险股份有限公司-传统险-汇添富国寿股份均衡股票传统可供出	124,122,800.00	46.12
2	张凯	15,004,100.00	5.58
3	胡雷	9,003,400.00	3.35
4	中信建投证券股	5,396,400.00	2.01

	份有限公司		
5	招商证券股份有 限公司	4,500,600.00	1.67
6	刘诗媛	3,527,100.00	1.31
7	任红娣	3,200,500.00	1.19
8	东方证券股份有 限公司	3,048,920.00	1.13
9	吕银海	2,624,800.00	0.98
10	中信证券股份有 限公司	2,411,500.00	0.90

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	129,111,220.00
本报告期基金总申购份额	248,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	108,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	269,111,220.00

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况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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	118,696,584.37	69.93	87,350.16	69.93	
东方证券	3	51,050,609.89	30.07	37,568.09	30.07	

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	-	-	-	-	
国投 证券	3	-	-	-	-	
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	-	-	-	-	
申港 证券	2	-	-	-	-	
申万 宏源 证券	2	-	-	-	-	
天风 证券	2	-	-	-	-	
招商 证券	3	-	-	-	-	
中泰 证券	1	-	-	-	-	
中信 建投 证券	2	-	-	-	-	
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	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-

申港 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 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公司投资研究总部/指数与量化投资部(合称“投资研究部门”)根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司,租用其交易单元。

(2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限,需符合相关法律法规规定的要求。(采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。)

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

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

(6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估,根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商,与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	2024 年 01 月 02 日
2	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京增财基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 17 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 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	2024 年 01 月 22 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华金证券为申购赎回代理券商的公告	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	2024 年 03 月 08 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 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	2024 年 03 月 29 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息资料的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 03 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富投资管理有限公司股东变更的公告	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	2024 年 04 月 16 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 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	2024 年 04 月 22 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加渤海证券为申购赎回代理券商的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 20 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华源证券为申购赎回代理券商的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 20 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加财达证券为申购赎回代理券商的公告	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	2024 年 06 月 03 日

12	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京中期时代基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 13 日
13	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024 年 2 月 8 日至 2024 年 6 月 30 日	-	124,122,800.00	-	124,122,800.00	46.12

产品特有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

3、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富沪深 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 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

2024 年 08 月 30 日