

# 汇添富恒生指数分级证券投资基金 2014 年 半年度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 21 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 2014 年 3 月 6 日(基金合同生效日)起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的权益投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	39
7.4 报告期内权益投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细.....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	46
7.10 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47

期末上市基金前十名持有人.....	48
8.2.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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的情况.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
11.1 备查文件目录.....	53
11.2 存放地点.....	54
11.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富恒生指数分级证券投资基金		
基金简称	汇添富恒生指数分级(QDII)		
场内简称	添富恒生		
基金主代码	164705		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年3月6日		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	125,171,847.20份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2014-04-11		
下属分级基金的基金简称:	添富恒生	恒生 A	恒生 B
下属分级基金的交易代码:	164705	150169	150170
报告期末下属分级基金的份 额总额	105,377,139.20份	9,897,354.00份	9,897,354.00份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数及标的指数所表征的股票市场相似的风险收益特征，在股票基金中属于中等风险、中等收益的产品。本基金为境外证券投资的基金，主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。此外，从投资者具体持有的基金份额来看，在分级运作期内，由于基金收益分配的安排，稳健收益类的恒生 A 份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额；积极收益类的恒生 B 份额则表现

	出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。
--	--

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	李芳菲
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-63201816
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		林利军	蒋超良

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.
	中文	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼

### 2.5 信息披露方式

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

### 2.6 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(2014年3月6日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	9,606,327.78
本期利润	11,347,465.51
加权平均基金份额本期利润	0.0202
本期加权平均净值利润率	2.02%
本期基金份额净值增长率	3.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	3,657,118.13
期末可供分配基金份额利润	0.0292
期末基金资产净值	130,014,806.90
期末基金份额净值	1.039
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	3.90%

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

2、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，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。

4、本基金的《基金合同》生效日为2014年3月6日，至本报告期末未满六个月，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2014年6月30日数据，特此说明。

#### 3.2 基金净值表现

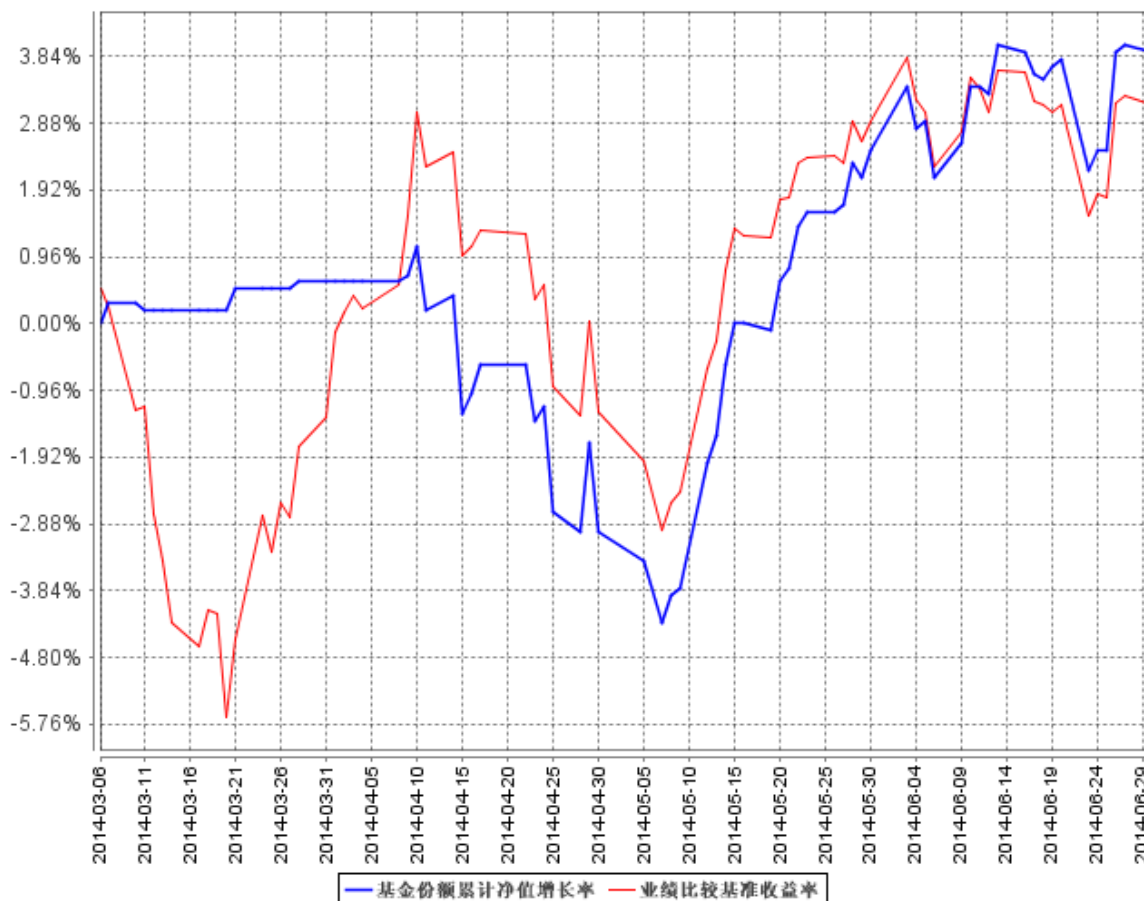
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.37%	0.63%	0.21%	0.63%	1.16%	0.00%
过去三个月	3.28%	0.67%	4.55%	0.72%	-1.27%	-0.05%
自基金合同生效日起至今	3.90%	0.59%	3.14%	0.78%	0.76%	-0.19%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2014 年 3 月 6 日，至本报告期末未满六个月。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的《基金合同》生效日为 2014 年 3 月 6 日，本基金建仓期为自《基金合同》生效之日（2014 年 3 月 6 日）起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。截至本报告期末，基金成立未满 1 年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立，注册资本为 1 亿元人民币。截止到 2014 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 981.54 亿元，有效客户数约 290 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 47 只开放式证券投资基金，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，包括汇



添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长股票型证券投资基金、汇添富成长焦点股票型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富香港优势股票型证券投资基金、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富理财 28 天债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金、汇添富消费行业股票型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽 30 股票型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富互利分级债券型证券投资基金、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富新收益债券型证券投资基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赖中立	汇添富上证综合指数、汇添富深证 300ETF、汇添富深证 300ETF 联接基金的基金经理助理，	2014 年 3 月 6 日	-	7 年	国籍：中国，学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士，相关业务资格：证券投资基金

	<p>汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)，汇添富恒生分级指数(QDII)的基金经理。</p>				<p>从业资格。从业经历：曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司任金融工程部分析师。2012年2月15日至今任汇添富上证综合指数基金、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理助理，2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)的基金经理，2014年3月6日至今任汇添富恒生分级指数(QDII)</p>
--	---	--	--	--	---

					基金的基金经理。
--	--	--	--	--	----------

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合，交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了同日反向交易控制的规则，同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内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总成交量 5%的交易次数为 4 次，其中 3 次是由于对

冲专户采取指数化策略投资导致，1 次是由于投资流动性的需求导致。经检查和分析未发现异常情况。

#### 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

2014 年上半年，香港恒生指数先抑后扬，从本基金成立以来区间涨幅为 2.71%。

4 月 10 日，中国证监会与香港证监会联合发布了两地开展沪港通相关消息，市场预期后续将有千亿级别的资金涌入市场，香港恒生指数应声大涨。随后国内市场 IPO 正式开闸，境内市场的恐慌情绪也蔓延至香港，导致恒生指数出现较大程度调整。5 月份后，随着境内市场逐渐企稳，再加上美国股市迭创新高，以及恒指成分股业绩增长良好，市场逐渐将注意力转移到港股基本面上，再叠加沪港通政策细则落实，恒生指数迎来较大幅度的上涨。

整个上半年，本基金按照基金合同，按照完全复制法进行恒生指数成分股指数化投资，严控基金跟踪误差，以为投资者带来与恒生指数一致的收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金成立以来上涨 3.90%，同期基准上涨 3.14%，超额收益为 0.76%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014 年下半年香港市场将迎来的最重大事件便是沪港通，从已有的时间表来看，沪港通将在 10 月份正式开闸，市场预期届时将有千亿级别的资金通过沪港通渠道进入香港股市，而香港股市成交量绝大部分集中于以恒生指数为代表的权重股上，预期资金面的推动将为恒生指数带来向上反弹的空间。

同时从全球经济复苏态势来看，美国已先期走出了金融危机的泥潭，当前处于弱复苏态势；而欧洲经济在欧央行全力放水的支持下，有望通过市场流动性的缓解来支撑经济增长；全球经济增长对香港市场中受益于全球经济复苏的股票业绩具有良好的支撑。而内地政府当前已将稳增长作为政府工作重点，从定向降准、央行公开操作等一些列措施来看，当前国内经济增长已接近政府的容忍下限，预期境内资金面宽松将持续。

总的来看，从经济基本面来看，港股业绩的提升是可期的。特别是作为市场旗舰指数的恒生指数，成分股将受益于全球经济复苏与内地经济的企稳，同时资金面的改善有望带来估值的提升，预期下半年香港市场将为投资者带来良好回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

报告期内，本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为, 汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上, 不存在损害基金份额持有人利益的行为; 在报告期内, 严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为, 汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定, 基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整, 未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：汇添富恒生指数分级证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	9,731,588.27
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	122,190,637.84
其中：股票投资		122,190,637.84
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		5,699,511.87
应收利息	6.4.7.5	1,986.42
应收股利		1,640,525.48
应收申购款		970.18
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	52,075.38
资产总计		139,317,295.44

负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日
<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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		8,907,270.32
应付管理人报酬		155,766.06
应付托管费		32,451.27
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	-
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	207,000.89
负债合计		9,302,488.54
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	125,171,847.20
未分配利润	6.4.7.10	4,842,959.70
所有者权益合计		130,014,806.90
负债和所有者权益总计		139,317,295.44

注：1、本基金于2014年3月6日成立，无比较式的上年度可比期间，因此资产负债表只列示2014 年6月30日数据，特此说明。

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

3、报告截止日2014 年6月30日，基金份额总额125,171,847.20 份，其中下属A 类基金份额净值1.019元，份额总额9,897,354.00份；下属B类基金份额净值1.059元，份额总额9,897,354.00份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期：2014 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		15,867,851.30
1.利息收入		2,515,497.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,515,497.36
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		-
<b>2.投资收益（损失以“-”填列）</b>		<b>3,666,787.84</b>
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-440,001.35
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.1	-
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	4,106,789.19
<b>3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）</b>	<b>6.4.7.18</b>	<b>1,741,137.73</b>
<b>4.汇兑收益（损失以“-”号填列）</b>		<b>6,501,570.78</b>
<b>5.其他收入（损失以“-”号填列）</b>	<b>6.4.7.19</b>	<b>1,442,857.59</b>
<b>减：二、费用</b>		<b>4,520,385.79</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,098,893.85
2. 托管费	6.4.10.2.2	437,269.53
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	1,775,548.80
5. 利息支出		0.00
其中：卖出回购金融资产支出		-
<b>6. 其他费用</b>	<b>6.4.7.21</b>	<b>208,673.61</b>
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>11,347,465.51</b>

注：本基金于2014年3月6日成立，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示从基金合同生效日至2014年6月30日数据，特此说明。



### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期：2014年3月6日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	11,347,465.51	11,347,465.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	125,171,847.20	-6,504,505.81	118,667,341.39
其中：1.基金申购款	1,272,926,851.64	16,674.93	1,272,943,526.57
2.基金赎回款	-1,147,755,004.44	-6,521,180.74	-1,154,276,185.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	125,171,847.20	4,842,959.70	130,014,806.90

注：本基金于2014年3月6日成立，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益变动表只列示从基金合同生效日至2014年6月30日数据，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

林利军  
基金管理人负责人

陈灿辉  
主管会计工作负责人

王小练  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富恒生指数分级证券投资基金（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[2013]1247 号文《关于核准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开发行人募集，基金合同于 2014 年 3 月 6 日正式生效，首次设立募集规模为 1,270,631,138.98 份基金份额。本基金为契约型开放式，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，本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司，境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司(The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.)。

本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于债券、基金（包括股票基金、债券基金、交易所交易基金等）、金融衍生工具（包括远期合约、互换、期货、期权、权证等）、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的 80%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金的业绩比较基准为：人民币汇率调整的恒生指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2014年6月30日的财务状况以及2014年3月6日（基金合同生效日）至6月30日的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2014年03月06日（基金合同生效日）起至2014年06月30日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债)，并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债；本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债；

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当

确认为当期收益；每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资；股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；卖出股票于成交日确认股票投资收益；卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资；债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资；权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益/(损失)；卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允

价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购)，以成本列示，按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### 1) 股票投资

##### (1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

##### (2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

C. 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

##### D. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的首次取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的首次取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

## 2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

## 3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

## 4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值；

#### 5)其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2)如有新增事项，按国家最新规定估值。

### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行机构代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发

行机构代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

如果恒生 A 份额与恒生 B 份额未终止运作，本基金存续期内（包括添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额）不进行收益分配。如果恒生 A 份额与恒生 B 份额终止运作，本基金将根据本基金合同的规定转为上市开放式基金（LOF），届时本基金将调整基金的收益分配，并遵循下列政策：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，场外投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。场内基金份额收益分配方式只能为现金分红；场内基金份额具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及登记机构的相关规定；



3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 外币交易**

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

于估值日，外币货币性项目采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入当期损益。以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额，作为公允价值变动的一部分直接计入当期损益。

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

#### **6.4.4.13 分部报告**

本基金的基金管理人以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定本基金的经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金同时满足下列条件的组成部分：

1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个经营分部运作。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本年度无会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本年度无会计估计变更。

#### **6.4.5.3 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税；

(2) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征收营业税和企业所得税；

(3) 基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

### 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 2014年6月30日
活期存款	9,731,588.27
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	9,731,588.27

注：本基金于2014年6月30日，银行存款中包含的外币余额为：港元239,465.32元（折合人民币190,075.60元），美元96.37元（折合人民币592.95元）。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	120,449,500.11	122,190,637.84	1,741,137.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	120,449,500.11	122,190,637.84	1,741,137.73

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	1,986.42
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	1,986.42

### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	52,075.38
合计	52,075.38

### 6.4.7.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末无应付交易费用。

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	33,569.61
预提审计费	34,983.00
预提信息披露费	116,612.73
预提指数使用费	21,835.55
合计	207,000.89

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,270,631,138.98	1,270,631,138.98
本期申购	2,295,712.66	2,295,712.66
本期赎回(以“-”号填列)	1,147,755,004.44	1,147,755,004.44
本期末	125,171,847.20	125,171,847.20

注：本期申赎份额含本基金三级份额之间的配对转换份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	9,606,327.78	1,741,137.73	11,347,465.51
本期基金份额交易产生的变动数	-5,949,209.65	-555,296.16	-6,504,505.81
其中：基金申购款	13,673.67	3,001.26	16,674.93
基金赎回款	-5,962,883.32	-558,297.42	-6,521,180.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,657,118.13	1,185,841.57	4,842,959.70

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日

活期存款利息收入	486,580.69
定期存款利息收入	2,028,916.67
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	2,515,497.36

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年 6月30日
卖出股票成交总额	337,382,443.87
减：卖出股票成本总额	337,822,445.22
买卖股票差价收入	-440,001.35

#### 6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期末有基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

注：本基金本报告期末有债券投资收益。

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期末有贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

注：本基金本期未投资衍生工具。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6 月30日
股票投资产生的股利收益	4,106,789.19

基金投资产生的股利收益	-
合计	4,106,789.19

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	1,741,137.73
——股票投资	1,741,137.73
——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	-
3. 其他	-
合计	1,741,137.73

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日
基金赎回费收入	1,442,857.59
合计	1,442,857.59

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日
交易所市场交易费用	1,775,548.80
银行间市场交易费用	-
合计	1,775,548.80

### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014 年6月30日
审计费用	34,983.00
信息披露费	116,612.73
上市费	22,924.62
银行汇划费	11,370.69
帐户维护费	947.02
指数使用费	21,835.55
合计	208,673.61

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控控股有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富资本管理有限公司	基金管理人施加重大影响的联营企业

## 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

注：本基金本报告期末未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期末未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期末未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期末未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

#### 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期末未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期末未有应支付关联方的佣金。

### 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
	2014 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,098,893.85
其中：支付销售机构的客户维护费	708,486.28

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。



### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	437,269.53	

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3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：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人在本报告期内未运用自有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期	
	2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	9,541,197.52	486,295.60
汇丰银行	190,390.75	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国农业银行和境外资产托管人汇丰银行保管，按适用利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金在本期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发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：本基金本期末未持有暂时停牌股票。

##### 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

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家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的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市；因此，本期末本基金的资产均能及时变现。

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

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款和部分应收申购款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,731,588.27	-	-	-	-	-	9,731,588.27
交易性金融资产	-	-	-	-	-	122,190,637.84	122,190,637.84
应收股利	-	-	-	-	-	1,640,525.48	1,640,525.48
应收利息	-	-	-	-	-	1,986.42	1,986.42
应收申购款	-	-	-	-	-	970.18	970.18
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,699,511.87	5,699,511.87
其他资产	-	-	-	-	-	52,075.38	52,075.38
-	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	9,731,588.27	-	-	-	-	129,585,707.17	139,317,295.44
负债							
应付赎回费						33,569.61	33,569.61
应付赎回款						8,907,270.32	8,907,270.32
应付管理人报酬						155,766.06	155,766.06
应付托管费						32,451.27	32,451.27
其他负债						173,431.28	173,431.28
负债总计						9,302,488.54	9,302,488.54
利率敏感度缺口	9,731,588.27					-120,283,218.63	130,014,806.90

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款及应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	592.95	190,075.60	-	190,668.55
交易性金融资产	-	122,190,637.84	-	122,190,637.84
应收股利	366,460.77	1,274,064.71	-	1,640,525.48
应收利息	-	7.17	-	7.17
应收证券清算款	-	5,699,511.87	-	5,699,511.87
资产合计	367,053.72	129,354,297.19	-	129,721,350.91
以外币计价的负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	367,053.72	129,354,297.19	-	129,721,350.91

### 6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月31日）
1	港币相对人民币升值 5%	6,182,739.27	-
2	港币相对人民币贬值 5%	-6,182,739.27	
3	美元相对人民币升值 5%	18,352.69	
4	美元相对人民币贬值 5%	-18,352.69	

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013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	122,190,637.84	93.98	-	-
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	122,190,637.84	93.98	-	-

注：本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，

基金还可投资于债券、基金（包括股票基金、债券基金、交易所交易基金等）、金融衍生工具（包括远期合约、互换、期货、期权、权证等）、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的 80%。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合的贝塔系数紧密相关；		
	本基金利用 MSCI BARRA 的因子风险模型计算其贝塔系数；		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	6,052,814.41	-
	业绩比较基准减少 5%	-6,052,814.41	-

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 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	122,190,637.84	87.71
	其中：普通股	122,190,637.84	87.71
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,731,588.27	6.99
8	其他各项资产	7,395,069.33	5.31
9	合计	139,317,295.44	100.00

## 7.2 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
工商业	49,798,204.18	38.30
金融业	54,997,449.24	42.30
地产行业	11,489,062.94	8.84
公共事业	5,905,921.48	4.54
合计	122,190,637.84	93.98

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	HSBC Holdings plc	汇丰控股	5 HK	香港证券交易所	香港	284,400	17,743,360.50	13.65
2	Tencent Holdings Limited	腾讯	700 HK	香港证券交易所	香港	113,700	10,667,476.13	8.20
3	China Construction Bank Corporation	建设银行	939 HK	香港证券交易所	香港	1,714,000	7,972,456.75	6.13
4	AIA Group	友邦保	1299 HK	香港证	香港	245,400	7,586,924.44	5.84

	Limited	险		券交易 所				
5	China Mobile Limited	中国移动	941 HK	香港证 券交易 所	香港	123,500	7,371,715.00	5.67
6	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	工商银 行	1398 HK	香港证 券交易 所	香港	1,503,000	5,845,730.63	4.50
7	Bank of China Limited	中国银 行	3988 HK	香港证 券交易 所	香港	1,619,000	4,459,231.94	3.43
8	CNOOC Limited	中国海 洋石油	883 HK	香港证 券交易 所	香港	364,000	4,021,836.00	3.09
9	Hutchison Whampoa Limited	和记黄 埔	13 HK	香港证 券交易 所	香港	43,000	3,617,912.50	2.78
10	PetroChina Company Limited	中国石 油	857 HK	香港证 券交易 所	香港	430,000	3,341,449.38	2.57
11	Cheung Kong (Holdings) Limited	长江实 业	1 HK	香港证 券交易 所	香港	28,000	3,055,937.50	2.35
12	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石 化	386 HK	香港证 券交易 所	香港	520,000	3,050,222.50	2.35
13	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	香港交 易所	388 HK	香港证 券交易 所	香港	22,500	2,580,679.69	1.98
14	China Life Insurance Company Limited	中国人 寿	2628 HK	香港证 券交易 所	香港	152,000	2,449,195.00	1.88
15	SUN HUNG KAI PROPERTIES LIMITED	新鸿基 地产	16 HK	香港证 券交易 所	香港	28,000	2,362,517.50	1.82
16	Galaxy Entertainment Group Limited	银河娱 乐	27 HK	香港证 券交易 所	香港	47,000	2,312,987.50	1.78
17	Sands China Ltd	金沙中 国有限 公司	1928 HK	香港证 券交易 所	香港	49,200	2,286,523.88	1.76
18	Ping An Insurance	中国平 安	2318 HK	香港证 券交易	香港	41,500	1,976,437.50	1.52



	(Group) Company of China Ltd			所				
19	CLP Holdings Limited	中电控股	2 HK	香港证券交易所	香港	38,500	1,943,576.25	1.49
20	The Hong Kong and China Gas Company Limited	香港中华煤气	3 HK	香港证券交易所	香港	128,600	1,731,213.20	1.33
21	Hang Seng Bank Limited	恒生银行	11 HK	香港证券交易所	香港	15,600	1,567,624.50	1.21
22	Power Assets Holdings Limited	电能实业	6 HK	香港证券交易所	香港	28,500	1,532,632.03	1.18
23	The Wharf (Holdings) Limited	九龙仓集团	4 HK	香港证券交易所	香港	31,000	1,373,028.75	1.06
24	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港	2388 HK	香港证券交易所	香港	75,500	1,345,386.41	1.03
25	Want Want China Holdings Limited	中国旺旺控股	151 HK	香港证券交易所	香港	148,000	1,308,671.50	1.01
26	China Overseas Land and Investment Ltd	中国海外发展	688 HK	香港证券交易所	香港	84,000	1,253,490.00	0.96
27	China Shenhua Energy Company Limited	中国神华	1088 HK	香港证券交易所	香港	69,000	1,226,820.00	0.94
28	China Unicom (Hong Kong) Limited	中国联通	762 HK	香港证券交易所	香港	122,000	1,160,113.25	0.89
29	Li and Fung Limited	利丰	494 HK	香港证券交易所	香港	120,000	1,093,470.00	0.84
30	Hengan International Group Company Limited	恒安国际	1044 HK	香港证券交易所	香港	16,500	1,068,705.00	0.82
31	SWIRE PACIFIC LIMITED A	太古股份公司	19 HK	香港证券交易所	香港	13,000	984,408.75	0.76
32	Lenovo Group Limited	联想集团	992 HK	香港证券交易所	香港	116,000	974,153.50	0.75

				所				
33	Hang Lung Properties Limited	恒隆地产	101 HK	香港证券交易所	香港	46,000	872,648.75	0.67
34	China Mengniu Dairy Company Limited	蒙牛乳业	2319 HK	香港证券交易所	香港	28,000	796,766.25	0.61
35	Henderson Land Development Company Limited	恒基地产	12 HK	香港证券交易所	香港	21,000	755,927.81	0.58
36	Bank of Communications CoLtd	交通银行	3328 HK	香港证券交易所	香港	178,000	755,888.13	0.58
37	New World Development Company Limited	新世界发展	17 HK	香港证券交易所	香港	105,000	735,091.88	0.57
38	The Bank of East Asia Limited	东亚银行	23 HK	香港证券交易所	香港	28,000	714,533.75	0.55
39	MTR Corporation Limited	港铁公司	66 HK	香港证券交易所	香港	29,500	698,956.41	0.54
40	China Resources Power Holdings Company Limited	华润电力	836 HK	香港证券交易所	香港	40,000	698,500.00	0.54
41	Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp	康师傅控股	322 HK	香港证券交易所	香港	40,000	688,975.00	0.53
42	Kunlun Energy Company Limited	昆仑能源	135 HK	香港证券交易所	香港	66,000	669,512.25	0.51
43	Belle International Holdings Limited	百丽	1880 HK	香港证券交易所	香港	95,000	648,493.75	0.50
44	Sino Land Company Limited	信和置业	83 HK	香港证券交易所	香港	60,000	607,695.00	0.47
45	China Resources Land Limited	华润置地	1109 HK	香港证券交易所	香港	42,000	472,725.75	0.36
46	China Merchants Holdings (International)	招商局国际	144 HK	香港证券交易所	香港	24,000	461,010.00	0.35

	Company Limited							
47	China Resources Enterprises Limited	华润创业	291 HK	香港证券交易所	香港	24,000	409,575.00	0.32
48	CITIC Pacific Limited	中信泰富	267 HK	香港证券交易所	香港	33,000	355,711.13	0.27
49	COSCO Pacific Limited	中远太平洋	1199 HK	香港证券交易所	香港	36,000	306,895.50	0.24
50	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LIMITED	国泰航空	293 HK	香港证券交易所	香港	24,000	275,844.00	0.21

## 7.4 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	HSBC Holdings plc	5 HK	66,634,148.32	51.25
2	Tencent Holdings Limited	700 HK	36,725,598.33	28.25
3	China Construction Bank Corporation	939 HK	29,101,024.60	22.38
4	AIA Group Limited	1299 HK	28,265,069.57	21.74
5	China Mobile Limited	941 HK	27,547,176.01	21.19
6	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	1398 HK	21,075,027.96	16.21
7	Bank of China Limited	3988 HK	17,258,908.65	13.27
8	CNOOC Limited	883 HK	13,978,238.65	10.75
9	Hutchison Whampoa Limited	13 HK	13,756,837.49	10.58
10	Cheung Kong (Holdings) Limited	1 HK	11,614,438.48	8.93
11	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	11,461,895.71	8.82
12	PetroChina Company Limited	857 HK	11,357,249.81	8.74
13	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	10,379,504.39	7.98
14	Galaxy Entertainment Group Limited	27 HK	9,876,271.51	7.60
15	Sands China Ltd.	1928 HK	9,152,289.16	7.04

16	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	388 HK	8,779,963.39	6.75
17	SUN HUNG KAI PROPERTIES LIMITED	16 HK	8,431,544.81	6.49
18	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd.	2318 HK	8,366,239.23	6.43
19	CLP Holdings Limited	2 HK	7,168,894.78	5.51
20	The Hong Kong and China Gas Company Limited	3 HK	6,277,812.08	4.83
21	Hang Seng Bank Limited	11 HK	6,046,386.18	4.65
22	Power Assets Holdings Limited	6 HK	5,923,483.90	4.56
23	Want Want China Holdings Limited	151 HK	5,725,796.74	4.40
24	China Overseas Land and Investment Ltd.	688 HK	5,421,168.43	4.17
25	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	2388 HK	5,360,969.09	4.12
26	The Wharf (Holdings) Limited	4 HK	5,239,701.11	4.03
27	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	4,816,077.46	3.70
28	Li and Fung Limited	494 HK	4,334,210.44	3.33
29	Hengan International Group Company Limited	1044 HK	4,132,327.56	3.18
30	China Unicom (Hong Kong) Limited	762 HK	3,919,665.53	3.01
31	Lenovo Group Limited	992 HK	3,791,032.00	2.92
32	China Mengniu Dairy Company Limited	2319 HK	3,629,273.44	2.79
33	SWIRE PACIFIC LIMITED A	19 HK	3,549,243.24	2.73
34	Hang Lung Properties Limited	101 HK	3,308,655.69	2.54
35	Bank of Communications Co. Ltd.	3328 HK	2,802,137.98	2.16
36	The Bank of East Asia Limited	23 HK	2,796,551.99	2.15
37	Henderson Land Development Company Limited	12 HK	2,754,102.40	2.12
38	Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp.	322 HK	2,727,168.36	2.10
39	MTR Corporation Limited	66 HK	2,615,273.28	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

**7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细**

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	HSBC Holdings plc	5 HK	48,992,777.68	37.68
2	Tencent Holdings Limited	700 HK	27,439,569.32	21.10
3	AIA Group Limited	1299 HK	21,460,628.46	16.51
4	China Construction Bank Corporation	939 HK	21,367,827.41	16.43
5	China Mobile Limited	941 HK	20,414,144.06	15.70
6	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	1398 HK	15,128,739.61	11.64
7	Bank of China Limited	3988 HK	12,831,448.77	9.87
8	CNOOC Limited	883 HK	10,744,775.59	8.26
9	Hutchison Whampoa Limited	13 HK	10,292,909.09	7.92
10	PetroChina Company Limited	857 HK	8,763,793.94	6.74
11	Cheung Kong (Holdings) Limited	1 HK	8,721,511.64	6.71
12	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	8,259,143.67	6.35
13	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	7,171,245.55	5.52
14	Galaxy Entertainment Group Limited	27 HK	6,869,969.56	5.28
15	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	388 HK	6,672,364.96	5.13
16	Sands China Ltd.	1928 HK	6,530,089.32	5.02
17	SUN HUNG KAI PROPERTIES LIMITED	16 HK	6,303,448.22	4.85
18	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd.	2318 HK	5,584,150.52	4.30
19	CLP Holdings Limited	2 HK	5,448,640.75	4.19
20	The Hong Kong and China Gas Company Limited	3 HK	4,768,498.96	3.67
21	Hang Seng Bank Limited	11 HK	4,447,461.47	3.42
22	Power Assets Holdings Limited	6 HK	4,343,957.24	3.34
23	Want Want China Holdings Limited	151 HK	3,954,636.93	3.04
24	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	2388 HK	3,872,950.42	2.98

25	The Wharf (Holdings) Limited	4 HK	3,841,328.35	2.95
26	China Overseas Land and Investment Ltd.	688 HK	3,709,447.47	2.85
27	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	3,388,013.96	2.61
28	Li and Fung Limited	494 HK	3,095,714.89	2.38
29	Lenovo Group Limited	992 HK	3,070,041.74	2.36
30	China Unicom (Hong Kong) Limited	762 HK	3,027,244.36	2.33
31	Hengan International Group Company Limited	1044 HK	3,004,661.73	2.31
32	SWIRE PACIFIC LIMITED A	19 HK	2,680,676.99	2.06

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	457,831,943.98
卖出收入（成交）总额	337,382,443.87

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 期末按债券信用等级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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

### 7.10 投资组合报告附注

#### 7.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一

年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.10.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	5,699,511.87
3	应收股利	1,640,525.48
4	应收利息	1,986.42
5	应收申购款	970.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	52,075.38
8	其他	-
9	合计	7,395,069.33

### 7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

## § 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

份额级别	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
添富恒生	3,453	30,517.56	942,699.08	0.89%	104,434,440.12	99.11%
恒生 A	318	31,123.75	408,146.00	4.12%	9,489,208.00	95.88%
恒生 B	349	28,359.18	2,077,811.00	20.99%	7,819,543.00	79.01%
合计	4,120	30,381.52	3,428,656.08	2.74%	121,743,191.12	97.26%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

### 恒生 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	王琦超	495,014.00	5.00%
2	招商证券股份有限公司	394,144.00	3.98%
3	丁碧霞	323,138.00	3.26%
4	邵秋华	253,602.00	2.56%
5	顾云卿	200,000.00	2.02%
6	高建国	194,402.00	1.96%
7	杨泳	150,015.00	1.52%
8	梁彩浓	150,009.00	1.52%
9	姚睿娇	130,008.00	1.31%
10	梁美霞	120,004.00	1.21%

### 恒生 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	何霈	2,556,185.00	25.83%
2	清华大学教育基金会	2,000,000.00	20.21%
3	刘爱媛	200,016.00	2.02%
4	郝清田	161,009.00	1.63%
5	董永霞	158,407.00	1.60%
6	李小礼	149,000.00	1.51%
7	陈武雄	138,900.00	1.40%
8	姚睿娇	130,007.00	1.31%
9	夏小妹	129,900.00	1.31%
10	钱芬	100,002.00	1.01%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	添富恒生	9,857.18	0.0094%
	恒生 A	-	-
	恒生 B	-	-
	合计	9,857.18	0.0079%

## 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的情况

项目	份额级别	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	添富恒生	0



投资和研究部门负责人持有本开放式基金	恒生 A	0
	恒生 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	添富恒生	0
	恒生 A	0
	恒生 B	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	添富恒生	恒生 A	恒生 B
基金合同生效日（2014 年 3 月 6 日）基金份额总额	1, 051, 208, 262. 98	109, 711, 438. 00	109, 711, 438. 00
本报告期期初基金份额总额	-	-	-
本报告期基金总申购份额	2, 295, 712. 66	0. 00	0. 00
减：本报告期基金总赎回份额	1, 147, 755, 004. 44	0. 00	0. 00
本报告期基金拆分变动份额	199, 628, 168. 00	-99, 814, 084. 00	-99, 814, 084. 00
本报告期期末基金份额总额	105, 377, 139. 20	9, 897, 354. 00	9, 897, 354. 00

注：拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘汤从珊女士担任汇添富理财 30 天债券型证券投资

资基金的基金经理。同时，曾刚先生不再担任该基金的基金经理。

2、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘汤从珊女士担任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理。同时，曾刚先生不再担任该基金的基金经理。

3、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘陆文磊先生担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理。同时，陈加荣先生不再担任该基金的基金经理。

4、基金管理人 2014 年 1 月 23 日公告，增聘何旻先生担任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。

5、《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》于 2014 年 3 月 6 日正式生效，赖中立先生任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2014 年 3 月 28 日公告，增聘雷鸣先生担任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理，与齐东超先生共同管理该基金。

7、基金管理人 2014 年 4 月 10 日公告，汇添富成长焦点股票型证券投资基金由雷鸣先生单独管理，齐东超先生不再管理该基金。

8、基金管理人 2014 年 4 月 10 日公告，增聘朱晓亮先生担任汇添富民营活力股票型证券投资基金的基金经理。同时，齐东超先生不再担任该基金的基金经理。

9、基金管理人 2014 年 4 月 10 日公告，增聘顾耀强先生担任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理，与韩贤旺先生、叶从飞先生、朱晓亮先生共同管理该基金。

10、《汇添富和聚宝货币市场基金基金合同》于 2014 年 5 月 28 日正式生效，汤从珊女士任该基金的基金经理。

11、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2014 年 3 月 6 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Instinet	1	401,337,622.74	50.50%	602,007.13	65.67%	-
招商国际	1	393,440,071.34	49.50%	314,752.10	34.33%	-
Deutsche Bank	1	-	-	-	-	-
KGI	1	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、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。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 4 家券商：Instinet、招商国际、Deutsche Bank 和 KGI。

## 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	汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014年1月21日
2	汇添富恒生指数分级证券投资基金招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014年1月21日
3	汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014年1月21日
4	汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014年1月21日
5	汇添富恒生指数分级证券投资基金托管协议	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014年1月21日
6	汇添富恒生指数分级证券投资基金上网发售提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014年1月24日
7	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金增加招商银行为代销机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014年1月25日
8	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金增加东海证券为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014年2月18日
9	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金增加恒泰证券为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014年2月25日
10	汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014年3月7日
11	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014年4月2日
12	汇添富恒生指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014年4月3日
13	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金参加部分销售机构定投基金、电子渠道申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014年4月3日
14	汇添富恒生指数分级证券投资基金之恒生A、恒生B基金份额上市	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管	2014年4月8日

	交易公告书	理人网站, 深交所	
15	汇添富基金管理股份有限公司关于客服中心变更办公地址的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 4 月 10 日
16	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金开通份额配对转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 4 月 11 日
17	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金之恒生 A、恒生 B 基金份额上市交易提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 4 月 11 日
18	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金 2014 年 4 月 18 日、4 月 21 日因境外市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 4 月 16 日
19	汇添富基金管理股份有限公司关于变更直销中心银行账户信息的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 4 月 21 日
20	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金 2014 年 5 月 6 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 4 月 30 日
21	汇添富基金管理股份有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2014 年 6 月 10 日
22	汇添富基金汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大同证券为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 6 月 11 日
23	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金 2014 年 7 月 1 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2014 年 6 月 27 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富恒生指数分级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、报告期内汇添富恒生指数分级证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

## 11.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理股份有限公司

## 11.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](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  
2014 年 8 月 25 日