

汇添富逆向投资股票型证券投资基金 2015 年半年度报告摘要

2015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：2015年8月29日

§ 1 重要提示

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 2015 年 8 月 27 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富逆向投资股票
基金主代码	470098
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 3 月 9 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	827,514,019.47 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要采用逆向投资策略进行主动投资管理，在科学严格的投资风险管理前提下，谋求基金资产长期稳健回报。
投资策略	本基金为股票型基金。股票投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘未被市场主流认同的价值被低估的股票以努力获取超额收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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	李鹏	林葛
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-68121816

2.4 信息披露方式

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

§ 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	831,208,498.00
本期利润	911,542,204.89
加权平均基金份额本期利润	1.0335
本期基金份额净值增长率	55.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	1.3264
期末基金资产净值	2,079,684,484.37
期末基金份额净值	2.513

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

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

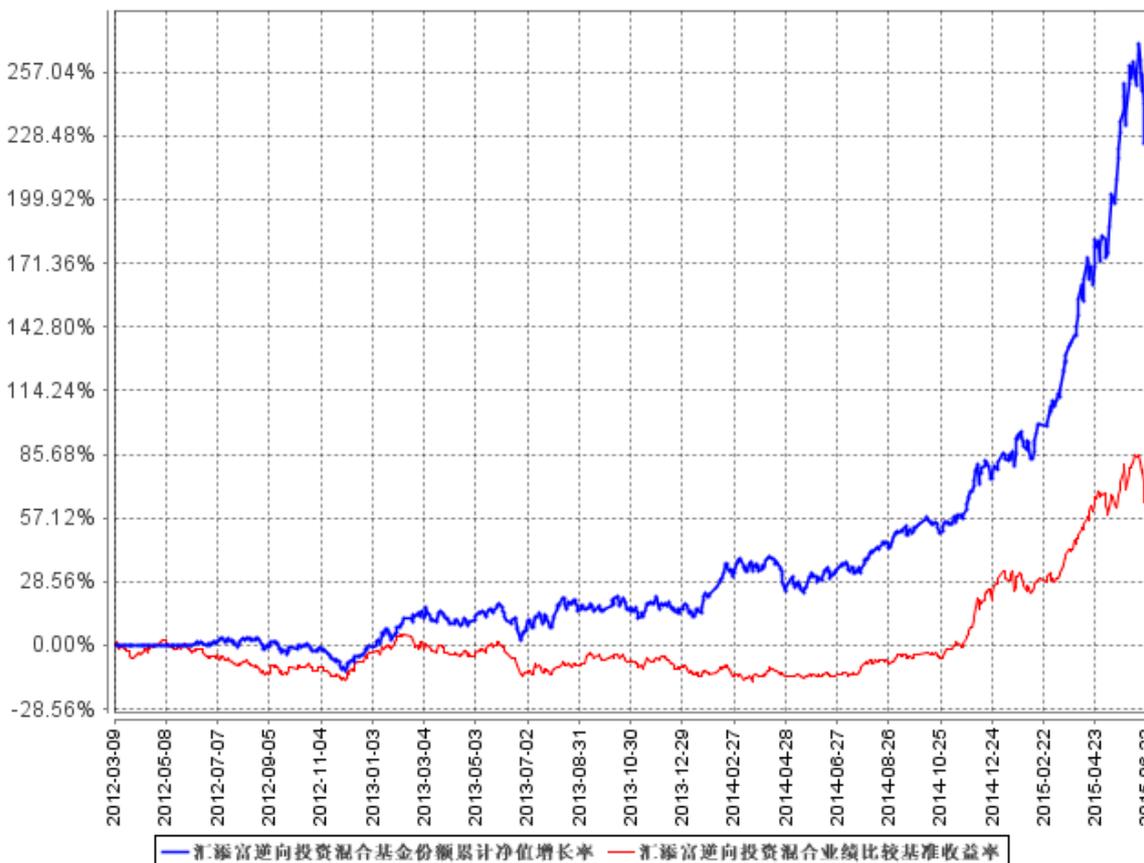
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-16.29%	3.35%	-5.85%	2.80%	-10.44%	0.55%
过去三个月	18.31%	2.77%	9.09%	2.09%	9.22%	0.68%
过去六个月	55.22%	2.20%	22.11%	1.81%	33.11%	0.39%
过去一年	108.37%	1.71%	82.76%	1.47%	25.61%	0.24%
过去三年	180.70%	1.40%	68.08%	1.20%	112.62%	0.20%

自基金合同 生效日起至 今	182.95%	1.33%	59.65%	1.17%	123.30%	0.16%
---------------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

注：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 06 月 27 日，至本报告期末已满 3 年、未满 5 年。

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

汇添富逆向投资混合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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2012 年 3 月 9 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理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，注册资本金为 1 亿元人民币。截止到 2015 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模

约 2,198.54 亿元，有效客户数约 600 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 53 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、汇添富添富货币市场基金、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、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富成长多因子量化策略股票基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
顾耀强	汇添富策略回报股票基金、	2012年3月9日	-	11年	国籍：中国。学历：清华大学

	<p>汇添富逆向投资股票基金、汇添富均衡增长股票基金的基金经理。</p>			<p>管理学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任高级行业分析师、基金经理助理，2009年12月22日至今任汇添富策略回报股票基金的基金经理，2012年3月9日至今任汇添富逆向投资股票基金的基金经</p>
--	--------------------------------------	--	--	---

					理，2014年4月8日至今任汇添富均衡增长股票基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---------------------------------

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遵规守信情况的说明

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

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 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

上半年 A 股市场在 6 月中下旬的调整之前基本延续了震荡上行态势，沪深 300 指数大涨 26.58%，创业板指数则是迭创历史新高，虽然 6 月底有所回落，整个上半年仍然上涨了 94.23%。互联网及互联网+仍是市场核心主题，工业 4.0、国企改革、一带一路等投资主题亦有反复发酵。管理层在不断完善资本市场的各项制度安排，总体上是越来越市场化，但对监管的要求也愈来愈高。一些资本市场的创新工具由此成为双刃剑，如融资融券，是市场 4、5 月份快速上涨的推手，也是此后市场流动性危机的源头。对投资者来说，则要不断应对各种新兴事物的挑战，包括天量融资，以及上市公司大面积停牌等带来的前所未有的流动性冲击等等。

上半年本基金继续坚持逆向投资策略，初期适度参与了包括互联网金融等在内的热门资产的配置，但在 4、5 月份市场强势上涨过程中不断降低相关资产的配置，并增加了低估值蓝筹及部分自下而上出现拐点的公司配置。但基于对市场中长期偏乐观的判断，在 6 月中下旬创业板的快速调整过程中过早进行了逆向操作，并在后期遭遇持仓股票停牌和市场流动性危机的冲击，导致了组合净值阶段性回撤幅度较大。未来的投资运作中需要继续坚持逆向投资纪律，同时加强组合的风险控制和流动性管理，以为持有人获取回撤风险可控的良好回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2015 年 6 月 30 日，本基金累计单位净值 2.663 元。自 2012 年 3 月 9 日成立以来，本基金累计收益率为 166.3%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经历前期剧烈调整之后，本基金对下半年市场的看法略偏积极。因为几个关键的支撑力量依然存在：（1）实体经济疲软背景下货币政策仍将保持宽松，而降息周期下居民资产再配置的需求空间巨大；（2）国家仍然在寻求经济结构转型与稳增长之间的战略平衡，众多上市公司也在新技术颠覆和传统模式难以为继的内外夹击下通过各种方式积极谋求转型；（3）上市公司整体估值水平已经回落到一个相对可以接受的区间。虽然也有一些负面的因素：（1）经历前期杠杆投资惨烈的风险教育之后，投资者将逐步理性，未来投资杠杆将逐步恢复到一个相对合理的水平；（2）实体经济下行的压力与转型的不确定性风险。但整体而言不应过于悲观。

从投资主题角度来看，我们继续看好互联网及互联网+在经济转型中的重要地位，无论是具备

创新基因的优秀互联网公司，还是能够在转型中占得先机的传统产业优秀公司，都值得重点关注。其次，医药医疗、大消费等领域中的能够保持稳健增长的优秀公司，在经历了很长时间的低迷之后，当前也已经具备较强吸引力。此外，一些细分行业如航空、养殖、化工等因为供求关系的改善而景气回升，也值得关注。

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、固定收益部、集中交易室、基金运营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验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于该次收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配。

本基金于本报告期内未实施利润分配。

§ 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 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合规守信、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：汇添富逆向投资股票型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	116,090,341.59	48,325,478.69
结算备付金	9,176,738.33	2,350,481.13
存出保证金	1,096,106.17	365,748.93
交易性金融资产	1,951,878,605.05	524,003,840.20
其中：股票投资	1,951,878,605.05	524,003,840.20
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	-	-
买入返售金融资产	-	-

应收证券清算款	100,845,749.43	-
应收利息	39,506.01	9,142.68
应收股利	-	-
应收申购款	7,410,421.39	3,967,537.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,186,537,467.97	579,022,229.53
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015年6月30日	2014年12月31日
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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	97,091,880.76	3,255,297.39
应付管理人报酬	3,710,247.61	685,134.12
应付托管费	618,374.59	114,189.02
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,992,326.29	1,462,035.37
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	440,154.35	112,260.86
负债合计	106,852,983.60	5,628,916.76
所有者权益:		
实收基金	827,514,019.47	354,072,692.71
未分配利润	1,252,170,464.90	219,320,620.06
所有者权益合计	2,079,684,484.37	573,393,312.77
负债和所有者权益总计	2,186,537,467.97	579,022,229.53

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额总额 827,514,019.47 份，基金份额净值 2.513 元。

6.2 利润表

会计主体：汇添富逆向投资股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年6月30日
一、收入	941,856,324.36	14,482,028.00

1.利息收入	764,433.34	94,444.95
其中：存款利息收入	764,433.34	88,090.73
债券利息收入	-	3,495.89
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	2,858.33
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	853,678,410.98	11,751,418.78
其中：股票投资收益	849,452,618.75	9,901,154.21
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-100,688.79
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	4,225,792.23	1,950,953.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	80,333,706.89	2,421,673.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7,079,773.15	214,490.57
减：二、费用	30,314,119.47	3,276,215.44
1. 管理人报酬	15,290,669.42	1,236,198.41
2. 托管费	2,548,444.89	206,033.05
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	12,356,013.74	1,654,502.44
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	118,991.42	179,481.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	911,542,204.89	11,205,812.56

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富逆向投资股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	354,072,692.71	219,320,620.06	573,393,312.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	911,542,204.89	911,542,204.89

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）	473,441,326.76	121,307,639.95	594,748,966.71
其中：1.基金申购款	2,878,058,154.22	3,418,140,875.68	6,296,199,029.90
2.基金赎回款	-2,404,616,827.46	-3,296,833,235.73	-5,701,450,063.19
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）	827,514,019.47	1,252,170,464.90	2,079,684,484.37
项目	上年度可比期间 2014年1月1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）	51,593,976.95	9,425,824.02	61,019,800.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,205,812.56	11,205,812.56
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）	273,628,705.64	95,652,412.35	369,281,117.99
其中：1.基金申购款	414,986,260.38	137,514,803.59	552,501,063.97
2.基金赎回款	-141,357,554.74	-41,862,391.24	-183,219,945.98
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）	-	-49,328,893.95	-49,328,893.95
五、期末所有者权益（基金净值）	325,222,682.59	66,955,154.98	392,177,837.57

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：

张晖
基金管理人负责人

陈灿辉
主管会计工作负责人

韩从慧
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富逆向投资股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1259号文《关于核准汇添富逆向投资股票型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)向社会公开发行募集,基金合同于2012年3月9日正式生效,首次设立募集规模为840,372,682.42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、注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 80% + 中证全债指数收益率 \times 20%。

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修订并发布的《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披

露》;修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，自 2015 年 4 月 3 日起，本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。除以上会计估计的变更，本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

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

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

2. 营业税、企业所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规

定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]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、国家税务总局财税字[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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1.1 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。

6.4.7.1.2 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、基金注册登记机构
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
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
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6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
东方证券股份 有限公司	930,314,927.97	11.12%	1,100,275,924.82	93.08%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6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
东方证券股份 有限公司	-	-	10,560,192.90	100.00%

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
东方证券股份 有限公司	-	-	7,000,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东方证券股份 有限公司	829,434.48	11.08%	617,286.37	12.36%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东方证券股份 有限公司	985,755.44	93.13%	583,011.90	88.91%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付 的管理费	15,290,669.42
其中：支付销售机构的客 户维护费	4,586,205.25	359,736.05

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日，支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付	2,548,444.89

的托管费		
------	--	--

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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和上年度末未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	116,090,341.59	696,298.56	114,303,268.51	75,253.07

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015 年度上半年度获得的利息收入为人民币 53,994.28 元(2014 年度可比期间结算备付金利息收入为人民币 7,424.12 元)，2015 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 9,176,738.33 元(2014 年可比期间结算备付金余额为人民币 813,821.28 元)。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间在承销期内均未参与关联方承销证券。

6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300228	富瑞特装	2015 年 6 月 24 日	非公开发行停牌	90.91	2015 年 7 月 30 日	81.82	719,526	43,318,000.78	65,412,108.66	-
300212	易华录	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	59.94	2015 年 7 月 13 日	54.00	278,900	18,892,625.11	16,717,266.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,951,878,605.05	89.27
	其中：股票	1,951,878,605.05	89.27
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	125,267,079.92	5.73
7	其他各项资产	109,391,783.00	5.00
8	合计	2,186,537,467.97	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	93,963,910.92	4.52
B	采矿业	202,234,398.17	9.72
C	制造业	944,047,046.68	45.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	402,483,928.80	19.35
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	84,954,818.18	4.08
J	金融业	90,537,464.88	4.35
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	48,995,000.00	2.36
N	水利、环境和公共设施管理业	18,863,517.92	0.91
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	65,798,519.50	3.16
	合计	1,951,878,605.05	93.85

7.2.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002589	瑞康医药	2,199,267	206,401,207.95	9.92
2	300006	莱美药业	2,936,700	125,984,430.00	6.06
3	000906	物产中拓	5,979,218	116,355,582.28	5.59
4	002363	隆基机械	2,999,901	101,426,652.81	4.88
5	600535	天士力	1,899,912	94,539,621.12	4.55
6	002714	牧原股份	1,599,658	93,963,910.92	4.52
7	601601	中国太保	2,999,916	90,537,464.88	4.35
8	600305	恒顺醋业	2,880,000	86,947,200.00	4.18
9	600867	通化东宝	3,776,996	82,829,522.28	3.98
10	601699	潞安环能	8,052,808	77,870,653.36	3.74

7.3 报告期内股票投资组合的重大变动

7.3.1 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	601601	中国太保	236,541,161.15	41.25
2	601166	兴业银行	177,340,992.80	30.93
3	300006	莱美药业	158,590,159.82	27.66
4	000975	银泰资源	136,860,514.11	23.87
5	002556	辉隆股份	128,922,473.05	22.48
6	002584	西陇化工	108,334,506.39	18.89
7	002363	隆基机械	107,568,650.88	18.76
8	300384	三联虹普	106,922,846.60	18.65
9	600845	宝信软件	106,569,602.99	18.59
10	601328	交通银行	104,517,672.39	18.23
11	002714	牧原股份	101,986,280.97	17.79
12	600172	黄河旋风	101,187,338.77	17.65
13	600535	天士力	98,953,623.09	17.26
14	000906	物产中拓	97,005,874.30	16.92
15	300228	富瑞特装	96,313,296.61	16.80

16	002236	大华股份	84,754,597.92	14.78
17	002589	瑞康医药	84,417,987.16	14.72
18	600260	凯乐科技	83,829,978.76	14.62
19	000937	冀中能源	77,330,016.36	13.49
20	002055	得润电子	74,855,744.63	13.05
21	601699	潞安环能	74,473,139.22	12.99
22	600711	盛屯矿业	67,981,625.40	11.86
23	600380	健康元	67,696,325.94	11.81
24	000566	海南海药	67,427,065.38	11.76
25	600867	通化东宝	67,231,633.65	11.73
26	000758	中色股份	67,130,533.45	11.71
27	000078	海王生物	66,632,083.03	11.62
28	601318	中国平安	64,832,375.44	11.31
29	300212	易华录	64,195,365.08	11.20
30	300165	天瑞仪器	57,303,481.30	9.99
31	600410	华胜天成	55,313,380.95	9.65
32	600809	山西汾酒	55,192,890.76	9.63
33	000402	金融街	53,549,034.27	9.34
34	300345	红宇新材	53,377,300.89	9.31
35	300358	楚天科技	51,932,128.34	9.06
36	600702	沱牌舍得	50,740,178.04	8.85
37	300380	安硕信息	50,099,479.69	8.74
38	300245	天玑科技	44,508,976.65	7.76
39	600998	九州通	44,282,474.78	7.72
40	002501	利源精制	43,788,374.73	7.64
41	300291	华录百纳	43,426,144.53	7.57
42	000043	中航地产	42,409,685.40	7.40
43	000001	平安银行	41,947,783.19	7.32
44	600005	武钢股份	41,102,542.56	7.17
45	600750	江中药业	38,476,261.72	6.71
46	600305	恒顺醋业	37,899,785.82	6.61
47	600517	置信电气	37,687,886.69	6.57
48	300273	和佳股份	35,877,474.00	6.26
49	002102	冠福股份	34,489,094.06	6.01
50	300144	宋城演艺	33,843,573.16	5.90
51	000638	万方发展	32,062,836.75	5.59

52	000858	五 粮 液	31,046,114.25	5.41
53	002018	华信国际	29,239,946.85	5.10
54	002475	立讯精密	28,856,122.07	5.03
55	002382	蓝帆医疗	28,817,217.47	5.03
56	600508	上海能源	28,442,547.16	4.96
57	600718	东软集团	27,368,812.74	4.77
58	002048	宁波华翔	27,286,805.83	4.76
59	300157	恒泰艾普	25,862,801.85	4.51
60	600493	凤竹纺织	25,193,303.64	4.39
61	000948	南天信息	24,867,463.13	4.34
62	000156	华数传媒	24,537,331.97	4.28
63	300383	光环新网	22,943,087.28	4.00
64	600706	曲江文旅	22,323,194.87	3.89
65	600309	万华化学	21,830,377.54	3.81
66	000915	山大华特	21,191,585.62	3.70
67	000876	新 希 望	19,422,041.76	3.39
68	002580	圣阳股份	19,365,475.49	3.38
69	601633	长城汽车	19,102,694.19	3.33
70	600530	交大昂立	18,656,370.00	3.25
71	002141	蓉胜超微	13,632,790.85	2.38
72	600211	西藏药业	11,604,488.00	2.02
73	000049	德赛电池	11,534,400.76	2.01

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。

7.3.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	196,764,258.00	34.32
2	300380	安硕信息	195,214,134.09	34.05
3	601318	中国平安	135,068,932.79	23.56
4	000948	南天信息	129,028,544.17	22.50
5	601601	中国太保	115,544,804.64	20.15
6	002055	得润电子	115,019,390.51	20.06
7	000078	海王生物	114,800,417.01	20.02
8	000937	冀中能源	111,595,257.38	19.46
9	601328	交通银行	110,181,416.88	19.22

10	002236	大华股份	107,508,451.33	18.75
11	600711	盛屯矿业	98,195,246.66	17.13
12	300228	富瑞特装	94,367,077.24	16.46
13	600702	沱牌舍得	92,378,186.34	16.11
14	000402	金融街	81,585,378.46	14.23
15	300291	华录百纳	78,228,873.49	13.64
16	000043	中航地产	70,949,204.50	12.37
17	000566	海南海药	70,274,057.64	12.26
18	000975	银泰资源	69,969,952.55	12.20
19	600380	健康元	65,965,946.93	11.50
20	002382	蓝帆医疗	63,696,738.86	11.11
21	601633	长城汽车	63,664,289.41	11.10
22	600517	置信电气	61,297,076.26	10.69
23	300384	三联虹普	61,204,529.73	10.67
24	300006	莱美药业	59,677,390.00	10.41
25	300144	宋城演艺	56,836,372.86	9.91
26	002018	华信国际	56,668,640.13	9.88
27	600998	九州通	51,887,204.56	9.05
28	300383	光环新网	51,607,466.50	9.00
29	600809	山西汾酒	50,771,820.64	8.85
30	600410	华胜天成	50,629,002.82	8.83
31	300212	易华录	50,371,101.20	8.78
32	600005	武钢股份	47,387,452.26	8.26
33	601988	中国银行	46,694,358.98	8.14
34	002141	蓉胜超微	46,677,834.31	8.14
35	300273	和佳股份	45,998,416.13	8.02
36	300245	天玑科技	45,813,267.26	7.99
37	002101	广东鸿图	44,231,162.12	7.71
38	000001	平安银行	41,709,246.91	7.27
39	600867	通化东宝	40,688,098.21	7.10
40	002501	利源精制	40,312,272.36	7.03
41	600845	宝信软件	39,480,638.00	6.89
42	300358	楚天科技	36,936,172.00	6.44
43	601699	潞安环能	35,469,145.60	6.19
44	600750	江中药业	35,341,081.10	6.16
45	002714	牧原股份	35,005,722.00	6.11
46	300345	红宇新材	33,268,553.10	5.80
47	600305	恒顺醋业	32,765,091.40	5.71

48	300157	恒泰艾普	32,603,894.06	5.69
49	000906	物产中拓	32,354,878.27	5.64
50	300255	常山药业	31,748,797.26	5.54
51	002556	辉隆股份	30,851,682.65	5.38
52	002048	宁波华翔	30,070,020.49	5.24
53	002475	立讯精密	29,834,235.52	5.20
54	000858	五粮液	29,573,084.62	5.16
55	600493	凤竹纺织	29,190,281.40	5.09
56	600571	信雅达	28,446,736.20	4.96
57	600718	东软集团	27,113,643.19	4.73
58	600508	上海能源	25,863,305.98	4.51
59	600415	小商品城	25,298,167.66	4.41
60	000156	华数传媒	25,013,061.22	4.36
61	002589	瑞康医药	24,030,970.24	4.19
62	000876	新希望	19,517,104.20	3.40
63	600309	万华化学	19,383,503.14	3.38
64	002580	圣阳股份	19,043,790.18	3.32
65	600211	西藏药业	12,242,409.15	2.14

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。

7.3.3 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	4,430,809,587.45
卖出股票收入（成交）总额	3,932,721,148.24

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

7.4 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投资。

7.5 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投资。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10 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持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	1,096,106.17
2	应收证券清算款	100,845,749.43
3	应收股利	-
4	应收利息	39,506.01
5	应收申购款	7,410,421.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	109,391,783.00

7.11.4 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。

7.11.5 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

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
40,801	20,281.71	247,831,358.86	29.95%	579,682,660.61	70.05%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,380,580.39	0.41%

8.3 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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年3月9日）基金份额总额	840,372,682.42
本报告期期初基金份额总额	354,072,692.71
本报告期基金总申购份额	2,878,058,154.22
减：本报告期基金总赎回份额	2,404,616,827.46
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	827,514,019.47

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

1、基金管理人 2015 年 1 月 8 日公告，汪洋先生不再担任汇添富中证主要消费 ETF、汇添富中证医药卫生 ETF、汇添富中证能源 ETF、汇添富中证金融地产 ETF 基金的基金经理，由吴振翔先生单独管理上述基金。

2、基金管理人 2015 年 1 月 8 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富深证 300ETF、汇添富深证 300ETF 联接基金的基金经理。同时，汪洋先生不再担任上述基金的基金经理。

3、基金管理人 2015 年 1 月 8 日公告，增聘雷鸣先生担任汇添富蓝筹稳健混合基金的基金经理，与叶从飞先生共同管理该基金。

4、基金管理人 2015 年 1 月 31 日公告，增聘李威先生担任汇添富外延增长股票基金的基金经理，与韩贤旺先生共同管理该基金。

5、基金管理人 2015 年 2 月 5 日公告，增聘刘闯先生担任汇添富医药保健股票基金的基金经理，与周睿先生共同管理该基金。

6、《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 16 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

7、基金管理人 2015 年 3 月 11 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财 21 天债券基金的基金经理，与曾刚先生共同管理上述基金。

8、基金管理人 2015 年 3 月 11 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富理财 14 天债券基金的基金经理，与王栩先生共同管理该基金。

9、《汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2015 年 3 月 24 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

10、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，陆文磊先生不再担任汇添富收益快线货币基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

11、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，陆文磊先生不再担任汇添富全额宝货币基金的基金经理，由汤从珊女士单独管理该基金。

12、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，曾刚先生不再担任汇添富现金宝货币基金、汇添富

理财 21 天债券基金的基金经理，由蒋文玲女士单独管理上述基金。

13、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，王栩先生不再担任汇添富理财 14 天债券基金的基金经理，由蒋文玲女士单独管理该基金。

14、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，曾刚先生不再担任汇添富理财 7 天债券基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

15、基金管理人 2015 年 4 月 17 日公告，新任李文先生为董事长，潘鑫军先生不再担任董事长。

16、基金管理人 2015 年 4 月 17 日公告，林利军先生不再担任法定代表人和总经理，由李文先生代为履行法定代表人职责，由张晖先生代为履行总经理职责。

17、基金管理人 2015 年 5 月 27 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富香港优势股票基金的基金经理，与王致人先生共同管理该基金。

18、基金管理人 2015 年 6 月 16 日公告，王致人先生不再担任汇添富香港优势股票基金的基金经理，由赖中立先生单独管理该基金。

19、《汇添富医疗服务灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 18 日正式生效，刘江先生任该基金的基金经理。

20、基金管理人 2015 年 6 月 27 日公告，新任李文先生为法定代表人，新任张晖先生为总经理。新任李鹏先生为督察长，李文先生不再担任督察长，张晖先生不再担任副总经理。

21、本报告期，基金托管人中国农业银行股份有限公司的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所(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

2015 年 1 月，针对上海证监局出具的整改措施，以及对相关负责人的警示，公司高度重视，

认真落实整改要求，加强制度和风控措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理能力。2015 年 4 月，公司已通过上海证监局的检查验收。

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	
中信建投	2	1,665,427,087.85	19.91%	1,490,609.79	19.91%	-
华创证券	1	1,575,206,801.31	18.83%	1,393,902.69	18.62%	-
方正证券	1	984,285,410.12	11.77%	896,088.00	11.97%	-
东方证券	2	930,314,927.97	11.12%	829,434.48	11.08%	-
齐鲁证券	1	594,545,689.58	7.11%	541,274.06	7.23%	-
东海证券	2	563,680,864.41	6.74%	498,801.61	6.66%	-
渤海证券	2	430,645,703.84	5.15%	392,056.60	5.24%	-
国泰君安	2	389,132,406.87	4.65%	344,343.02	4.60%	-
长江证券	2	381,590,046.93	4.56%	342,457.00	4.57%	-
海通证券	2	378,668,418.50	4.53%	335,084.19	4.48%	-
国金证券	2	154,531,658.56	1.85%	140,684.18	1.88%	-
恒泰证券	2	130,336,688.97	1.56%	115,334.75	1.54%	-
中投证券	2	77,313,212.06	0.92%	70,385.66	0.94%	-
招商证券	2	52,391,607.22	0.63%	46,361.06	0.62%	-
国联证券	1	37,288,474.39	0.45%	33,947.32	0.45%	-
兴业证券	2	18,107,327.11	0.22%	16,023.27	0.21%	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	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	
	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
中信建投	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

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

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

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

2、 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

此 37 个交易单元与汇添富信用债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、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金共用。本基金本报告期无新增或退租交易单元。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金管理人 2015 年 8 月 5 日刊登的《汇添富基金管理股份有限公司关于变更旗下“股票型证券投资基金”的基金名称并相应修订基金合同部分条款的公告》，汇添富逆向投资股票型证券投资基金自 2015 年 8 月 5 日起更名为汇添富逆向投资混合型证券投资基金。

汇添富基金管理股份有限公司
2015 年 8 月 29 日