

# 汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资 基金 2015 年半年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 2 月 16 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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
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.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	16
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>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	50

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>60</b>
11.1 备查文件目录.....	60
11.2 存放地点.....	60
11.3 查阅方式.....	60

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金
基金简称	汇添富成长多因子量化策略股票
基金主代码	001050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 16 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,087,580,296.61 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在严格控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资于成长型行业的股票，采用基金管理人的金融工程团队开发的多因子量化策略进行选股。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×90% + 活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的基金产品。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	蒋松云
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140

法定代表人	林利军	姜建清
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 2 月 16 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	527,327,313.41
本期利润	407,541,729.81
加权平均基金份额本期利润	0.2083
本期加权平均净值利润率	17.16%
本期基金份额净值增长率	29.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	517,736,764.05
期末可供分配基金份额利润	0.2480
期末基金资产净值	2,698,606,120.18
期末基金份额净值	1.293
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	29.30%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

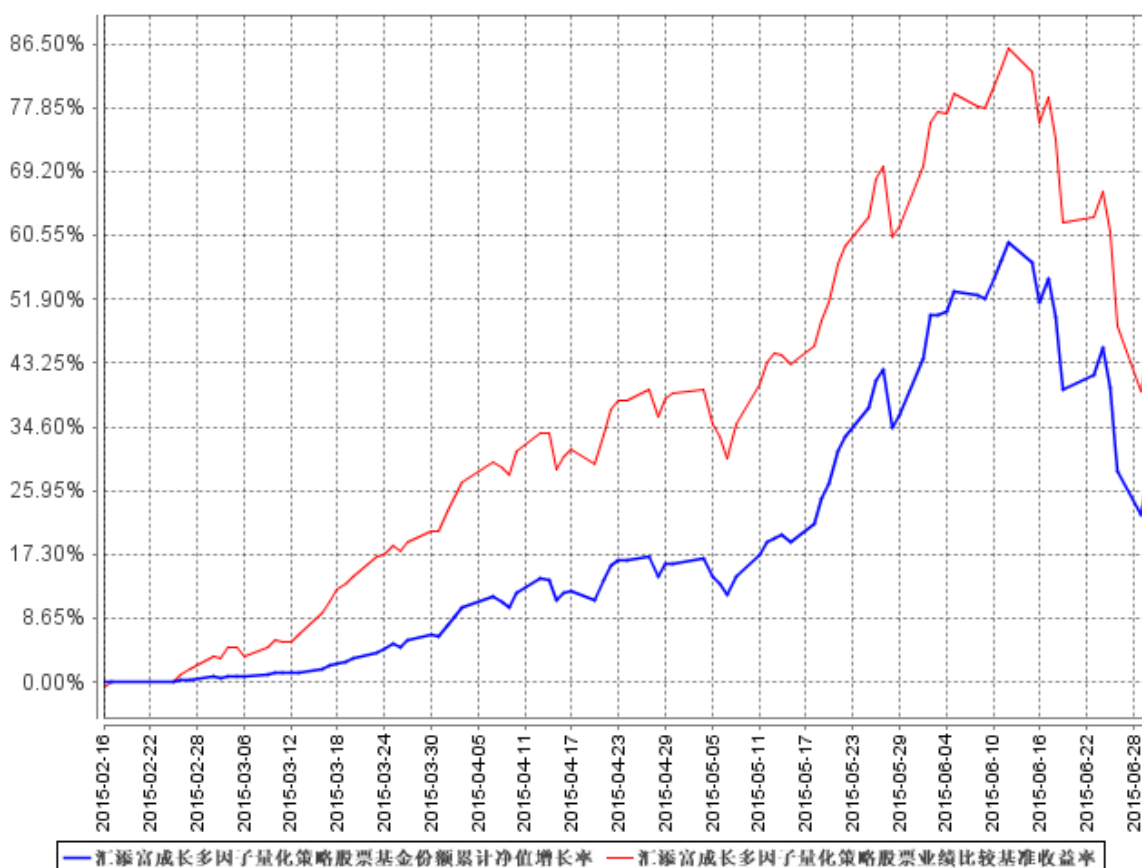
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.07%	3.69%	-9.51%	3.41%	4.44%	0.28%
过去三个月	21.64%	2.57%	20.59%	2.61%	1.05%	-0.04%
自基金合同生效日起至 今	29.30%	2.15%	45.11%	2.23%	-15.81%	-0.08%

注：本基金的《基金合同》生效之日为 2015 年 2 月 16 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

汇添富成长多因子量化策略股票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：本基金建仓期为自本《基金合同》生效之日为 2015 年 2 月 16 日，截至本报告期末，基金成立未满 6 个月；本基金建仓期为自本《基金合同》生效之日（2015 年 2 月 16 日）起 6 个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

## §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、汇添富医疗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、汇添富添富通货币市场基金、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		
吴振翔	汇添富上证综合指数、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、汇添富沪深 300 安中指数基金、汇添富成长多因子股票基金、汇添富主要消费 ETF 联接基金的基金经理，指数与量化投资部副总监。	2015 年 2 月 16 日	-	9 年	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2

					<p>月 5 日至 今任汇添 富上证综 合指数基 金的基金 经理， 2011 年 9 月 16 日 至 2013 年 11 月 7 日任汇 添富深证 300ETF 基 金的基金 经理， 2011 年 9 月 28 日 至 2013 年 11 月 7 日任汇 添富深证 300ETF 基 金联接基 金的基金 经理， 2013 年 8 月 23 日 至今任中 证主要消 费 ETF 基 金、中证 医药卫生 ETF 基金、 中证能源 ETF 基金、 中证金融 地产 ETF 基金的基 金经理， 2013 年 11 月 6 日 至今任汇 添富沪深 300 安中 指数基金</p>
--	--	--	--	--	---

					的基金经理，2015年2月16日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理，2015年3月24日至今任汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

上半年经济仍不见起色，整体处于弱复苏态势。宏观上各项激发实体经济活力的自上而下的改革仍在强有力的推进中，微观经济的活力被进一步激发，“一带一路”、“亚投行”等外部战略让国民看到了大国崛起的雄心和高层的战略视野。一系列改革的鼓舞了市场参与者的乐观情绪，在财富效应带来的增量资金和杠杆的共同作用下，“疯牛”行情持续到了六月上旬。但从六月中旬开始，由于去杠杆和市场情绪的波动，市场进入了由于流动性导致的急跌行情。整体看，杠杆资金的顺周期特性在上半年的暴涨暴跌中扮演了推波助澜的作用。

报告期内，本基金遵循量化基金投资原则，保持了较为均衡的成长风格。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内从基金成立以来，成长多因子基金收益 29.30%，业绩比较基准收益率 45.11%，基金业绩大幅低于业绩比较基准的原因主要在于基金成立日开始的建仓期间，市场大幅上涨，本基金仓位不足所造成的，在打开申购赎回之后的期间里，基金业绩相对于业绩比较基准是有较好正超额收益的。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然股市目前面临较大的压力，但引发本轮牛市的经济转型的大背景仍未发生变化。宏观上看，各项国家战略仍在推进。对内，国企改革、区域发展战略、创新驱动发展战略仍在持续激发经济转型潜力；对外，“一带一路”等“走出去”战略仍在有条不紊的推进。微观上，万众创新的激情已被点燃，加之简政放权不断打破以往约束经济活力的条条框框，企业认同转型方向并积极参与其中，涌现了众多充满活力的创新型企业。互联网带来的生产力改进仍在进行中，科技创新仍是中长期市场的关注度。周期上看，目前经济仍存在下行压力，政府不断有新的“稳增长”

政策出台，大量的基础设施投资的启动和房地产需求的改善能对实体经济起到良好的托底作用。主题政策上，“一带一路”、“中国制造 2025”、“京津冀”等主题从对概念的炒作转移到具体的实施上，经过前期调整，相关标的出现了较好的投资机会。

目前市场仍在下跌过程中，但场外场内杠杆正在逐步降低，市场估值逐步回归合理，同时监管层的救市举措也能起到一定的安抚市场作用，目前市场悲观情绪可能会在短期稳定下来。由于本轮暴跌主要由于流动性因素导致，改革牛的大背景仍未发生变化，一旦市场信心恢复，前期超跌的股票会有一定修复行情，但套牢资金也会给市场的反弹造成一定压力，三季度市场可能整体呈现震荡状态。目前市场的估值关注点逐渐从公司的市值空间重新回到公司基本面上，成长多因子基金配置均衡，使用量化策略筛选基本面较为良好，估值较为合理的公司，未来可能会有一定表现。

作为量化投资基金，汇添富成长多因子量化策略基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的量化投资策略，追求相对业绩比较基准的较为稳定的超额收益。我们非常期望汇添富成长多因子量化策略基金能继续与投资者一起分享中国经济的美好未来。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、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 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对汇添富成长多因子量化策略股票证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，汇添富成长多因子量化策略股票证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富成长多因子量化策略股票证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人依法对汇添富基金管理有限公司编制和披露的汇添富成长多因子量化策略股票证券投资基金 2015 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富成长多因子量化策略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	附注号	本期末 2015年6月30日
<b>资产:</b>		
银行存款	6.4.7.1	201,921,491.40
结算备付金		11,913,430.67
存出保证金		494,649.93
交易性金融资产	6.4.7.2	2,520,888,499.41
其中: 股票投资		2,520,084,935.11
基金投资		-
债券投资		803,564.30
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		171,310,757.12
应收利息	6.4.7.5	48,955.72
应收股利		-
应收申购款		17,709,276.10
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		2,924,287,060.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		215,481,228.63
应付管理人报酬		4,155,464.80
应付托管费		692,577.44
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	5,019,616.19
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	332,053.11
负债合计		225,680,940.17
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	2,087,580,296.61
未分配利润	6.4.7.10	611,025,823.57
所有者权益合计		2,698,606,120.18

负债和所有者权益总计		2,924,287,060.35
------------	--	------------------

注：1、由于本基金于 2015 年 2 月 16 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 2015 年 6 月 30 日数据，特此说明。

2、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.293 元，基金份额总额 2,087,580,296.61 份。

3、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		431,849,520.26
1.利息收入		9,700,055.86
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,620,090.54
债券利息收入		46.06
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,079,919.26
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		528,218,750.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	518,661,288.42
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	9,557,462.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-119,785,583.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	13,716,297.02
<b>减：二、费用</b>		24,307,790.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,129,709.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,188,284.87
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	8,861,709.26
5. 利息支出		-



其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	128,086.75
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>407,541,729.81</b>

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、本基金合同于 2015 年 2 月 16 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示本期数据，特此说明。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 2 月 16 日(基金合同生效日)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）	1,903,140,954.30	-	1,903,140,954.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	407,541,729.81	407,541,729.81
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）	184,439,342.31	203,484,093.76	387,923,436.07
其中：1.基金申购款	2,277,810,435.17	928,396,769.79	3,206,207,204.96
2.基金赎回款	-2,093,371,092.86	-724,912,676.03	-2,818,283,768.89
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）	2,087,580,296.61	611,025,823.57	2,698,606,120.18

注：本基金于 2015 年 2 月 16 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益(基金净值)变动表只列示本期数据，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

陈灿辉

韩从慧

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

汇添富成长多因子量化策略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[2015]117号文《关于核准汇添富成长多因子量化策略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2015年2月16日正式生效，首次设立募集规模为1,903,140,954.30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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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（包含中小板、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、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在严格控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×90% + 活期存款利率（税后）×10%。

### 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，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编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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 重要会计政策和会计估计

##### 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。

##### 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及贷款和应收款项；

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和债券等投资。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、存出保证金和各类应收款项等。

(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均划分为其他金融负债，主要包括各类应付款项。

##### 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

###### 初始确认

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，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。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取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

###### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类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；应收款项及其他金

融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

#### 终止确认

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，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；当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；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。

#### 金融资产转移

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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，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，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最

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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 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**

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；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。

#### **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企业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企业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 1.50%年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购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；

(4) 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

(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，最少一次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，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；

(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) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 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

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

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。

### 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

### 1. 印花税

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

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

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

### 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的

规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 3. 个人所得税

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

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

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

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 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 2015年6月30日
活期存款	201,921,491.40
定期存款	-
其他存款	-
合计：	201,921,491.40

注：本基金本期末未投资于定期存款。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,640,121,083.01	2,520,084,935.11	-120,036,147.90
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	803,564.30	250,564.30
	银行间市场	-	-
	合计	803,564.30	250,564.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,640,674,083.01	2,520,888,499.41	-119,785,583.60

### 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 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	43,884.33
应收定期存款利息	0.09
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	4,824.90
应收债券利息	46.06
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	200.34
合计	48,955.72

注：“其他”为结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	5,019,616.19
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,019,616.19

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	205,092.36
预提费用	126,960.75
合计	332,053.11

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额

基金合同生效日	1,903,140,954.30	1,903,140,954.30
本期申购	2,277,810,435.17	2,277,810,435.17
本期赎回(以“-”号填列)	-2,093,371,092.86	-2,093,371,092.86
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,087,580,296.61	2,087,580,296.61

注：本期申购中包含红利再投、转换入份额，本期赎回中包含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	527,327,313.41	-119,785,583.60	407,541,729.81
本期基金份额交易产生的变动数	-9,590,549.36	213,074,643.12	203,484,093.76
其中：基金申购款	309,022,866.71	619,373,903.08	928,396,769.79
基金赎回款	-318,613,416.07	-406,299,259.96	-724,912,676.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	517,736,764.05	93,289,059.52	611,025,823.57

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月16日(基金合同生效日)至2015年 6月30日
活期存款利息收入	1,017,890.39
定期存款利息收入	7,541,805.65
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	48,895.76
其他	11,498.74
合计	8,620,090.54

注：表中“其他”为直销申购款和保证金利息收入。

#### 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 2015年2月16日(基金合同生效日)至2015 年6月30日

卖出股票成交总额	2,229,521,166.77
减：卖出股票成本总额	1,710,859,878.35
买卖股票差价收入	518,661,288.42

### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本期末未持有贵金属。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本期末未投资衍生工具。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月16日(基金合同生效日)至2015年 6月30日
股票投资产生的股利收益	9,557,462.56
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,557,462.56

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年2月16日(基金合同生效日)至 2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-119,785,583.60
——股票投资	-120,036,147.90
——债券投资	250,564.30
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
合计	-119,785,583.60

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月16日(基金合同生效日)至2015 年6月30日
基金赎回费收入	13,716,297.02
合计	13,716,297.02

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月16日(基金合同生效日)至2015 年6月30日
交易所市场交易费用	8,861,709.26
银行间市场交易费用	-
合计	8,861,709.26

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月16日(基金合同生效日)至 2015年6月30日
审计费用	38,087.55
信息披露费	88,873.20
银行划款费用	1,126.00
合计	128,086.75

### 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

注：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

注：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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控有限责任公司	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年2月16日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东方证券股份 有限公司	2,597,901,578.21	39.48%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.5 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2月16日(基金合同生效日)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	2,302,303.28	39.06%	2,059,241.40	41.02%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年2月16日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,129,709.57
其中：支付销售机构的客户维护费	6,857,107.90

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 1.50\% /$ 当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

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付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年2月16日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,188,284.87

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：

$H = E \times 0.25\% /$ 当年天数

H 为每日应支付的基金托管费

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

管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期末未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内未运用固有资金投资本基金。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日	
	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	9,999,000.00	0.4800%

注：东方证券股份有限公司于 2015 年 2 月 12 日运用 10,000,000.00 元认购本基金份额 9,999,000.00 份（含募集期利息结转的份额），认购费用 1,000.00 元，符合招募说明书规定的认购费率。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	201,921,491.40	1,017,890.39

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 半年度获得的利息收入为人民币 48,895.76 元，2015 年半年末结算备付金余额为人民币 11,913,430.67 元。

#### 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：本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000732	泰禾集团	2015年6月25日	重大事项停牌	34.20	2015年7月2日	30.78	925,737	30,403,751.03	31,660,205.40	-
000963	华东医药	2015年6月26日	重大事项停牌	71.48	2015年8月5日	69.20	293,696	20,677,494.78	20,993,390.08	-
002003	伟星股份	2015年6月5日	重大事项停牌	16.17	-	-	1,192,140	13,572,004.24	19,276,903.80	-
600499	科达洁能	2015年6月10日	重大资产重组停牌	29.64	-	-	611,800	17,893,204.48	18,133,752.00	-
300195	长荣股份	2015年6月23日	重大事项停牌	31.96	2015年8月24日	28.76	480,580	17,272,328.99	15,359,336.80	-
000650	仁和药业	2015年6月12日	重大事项停牌	17.17	-	-	892,500	9,073,659.87	15,324,225.00	-
300164	通源石油	2015年5月28日	重大资产重组停牌	17.14	-	-	872,880	11,588,219.19	14,961,163.20	-
300255	常山	2015	重大	34.71	2015	31.24	429,765	9,307,248.88	14,917,143.15	-

	药业	年 6 月 3 日	事项停牌		年 7 月 13 日					
000716	黑芝麻	2015 年 6 月 8 日	重大事项停牌	23.69	2015 年 8 月 3 日	21.32	519,009	12,937,254.32	12,295,323.21	-
000543	皖能电力	2015 年 6 月 15 日	重大事项停牌	21.36	2015 年 7 月 14 日	19.22	571,500	9,132,969.40	12,207,240.00	-
002091	江苏国泰	2015 年 6 月 1 日	重大资产重组停牌	26.22	-	-	455,600	9,155,775.67	11,945,832.00	-
000903	云内动力	2015 年 6 月 2 日	重大事项停牌	12.39	2015 年 7 月 27 日	11.10	930,200	8,991,728.26	11,525,178.00	-
600587	新华医疗	2015 年 5 月 22 日	重大事项停牌	58.63	2015 年 7 月 3 日	52.77	195,700	8,037,162.89	11,473,891.00	-
300056	三维丝	2015 年 6 月 5 日	重大资产重组停牌	46.55	-	-	195,854	5,775,924.88	9,117,003.70	-
002045	国光电器	2015 年 6 月 1 日	重大事项停牌	13.92	2015 年 7 月 14 日	12.53	642,600	6,336,525.81	8,944,992.00	-
002368	太极股份	2015 年 5 月 14 日	重大资产重组停牌	65.52	-	-	134,361	5,764,049.77	8,803,332.72	-
300381	溢多利	2015 年 4 月 22 日	重大资产重组停牌	40.89	2015 年 8 月 13 日	44.96	196,600	7,035,851.36	8,038,974.00	-
002557	洽洽食品	2015 年 6 月 29 日	重大事项停牌	16.38	2015 年 8 月 24 日	14.74	471,800	7,683,675.73	7,728,084.00	-
600622	嘉宝集团	2015 年 5 月	重大事项	13.86	2015 年 7 月	12.47	555,400	6,703,572.35	7,697,844.00	-

		月 26 日	停牌		月 2 日					
600763	通策医疗	2015 年 5 月 25 日	重大资产重组停牌	110.36	-	-	64,900	5,959,713.85	7,162,364.00	-
002354	天神娱乐	2015 年 5 月 28 日	重大资产重组停牌	96.97	2015 年 7 月 23 日	87.27	69,800	6,623,655.86	6,768,506.00	-
600967	北方创业	2015 年 4 月 13 日	重大资产重组停牌	17.12	-	-	380,200	5,997,146.93	6,509,024.00	-
002020	京新药业	2015 年 4 月 16 日	重大资产重组停牌	27.21	2015 年 8 月 10 日	26.10	176,075	3,655,365.55	4,791,000.75	-
600366	宁波韵升	2015 年 5 月 22 日	重大资产重组停牌	35.09	2015 年 8 月 12 日	31.58	128,800	3,220,660.47	4,519,592.00	-
600879	航天电子	2015 年 5 月 15 日	重大资产重组停牌	24.50	-	-	154,700	3,087,207.19	3,790,150.00	-
300196	长海股份	2015 年 5 月 18 日	重大事项停牌	35.41	2015 年 8 月 18 日	31.87	95,200	2,855,535.46	3,371,032.00	-
600645	中源协和	2015 年 4 月 27 日	重大资产重组停牌	79.34	-	-	38,700	1,892,174.00	3,070,458.00	-
002586	围海股份	2015 年 5 月 4 日	重大资产重组停牌	12.45	-	-	148,200	931,565.00	1,845,090.00	-
000786	北新建材	2015 年 4 月 10 日	重大资产重组停牌	18.58	-	-	72,000	1,202,180.00	1,337,760.00	-
600461	洪城水业	2015 年 2 月	重大资产	13.10	2015 年 8 月	11.66	80,200	950,713.50	1,050,620.00	-

		月 26 日	重组 停牌		月 26 日					
002268	卫 士 通	2015 年 5 月 8 日	重大 事项 停牌	80.14	2015 年 8 月 4 日	76.32	8,600	467,948.38	689,204.00	-
300294	博雅 生物	2015 年 4 月 23 日	重大 资产 重组 停牌	78.83	-	-	8,200	479,610.59	646,406.00	-
300113	顺网 科技	2015 年 5 月 5 日	重大 事项 停牌	57.70	2015 年 8 月 6 日	51.93	11,000	412,706.05	634,700.00	-
002116	中国 海诚	2015 年 4 月 23 日	重大 事项 停牌	19.21	2015 年 7 月 24 日	21.13	31,720	474,575.18	609,341.20	-
000022	深赤 湾 A	2015 年 4 月 23 日	重大 事项 停牌	26.69	-	-	21,200	492,006.08	565,828.00	-
300008	上海 佳豪	2015 年 3 月 24 日	重大 资产 重组 停牌	17.24	-	-	20,500	298,853.00	353,420.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2015 年 6 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金融资产款余额

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：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

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

构，并明确了相应的风险管理职能。

#### 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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	803,564.30	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	803,564.30	-

#### 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。

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、部分应收申购款及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015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	201,921,491.40	-	-	-	-	-	201,921,491.40
结算备付金	11,913,430.67	-	-	-	-	-	11,913,430.67
存出保证金	494,649.93	-	-	-	-	-	494,649.93
交易性金融资产	-	-	803,564.30	-	-	-2,520,084,935.11	2,520,888,499.41
应收证券清算款	-	-	-	-	-	171,310,757.12	171,310,757.12
应收利息	-	-	-	-	-	48,955.72	48,955.72
应收申购款	5,852,890.82	-	-	-	-	11,856,385.28	17,709,276.10
资产总计	220,182,462.82	-	803,564.30	-	-	-2,703,301,033.23	2,924,287,060.35
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	215,481,228.63	215,481,228.63
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,155,464.80	4,155,464.80
应付托管费	-	-	-	-	-	692,577.44	692,577.44
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,019,616.19	5,019,616.19
其他负债	-	-	-	-	-	332,053.11	332,053.11
负债总计	-	-	-	-	-	225,680,940.17	225,680,940.17
利率敏感度缺口	220,182,462.82	-	803,564.30	-	-	-2,477,620,093.06	2,698,606,120.18

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

注：本基金的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

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的债券，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 2015年6月30日		上年度末 2014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	2,520,084,935.11	93.38	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	803,564.30	0.03	-	-
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	2,520,888,499.41	93.41	-	-

注：本基金投资组合中股票资产占基金资产的80%-95%；其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款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。其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表所示。

#### 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，即与基金所投资证券的贝塔系数紧密相关；		
	对于上市时间不足一年的股票，使用申银万国行业指数替代股票价格计算其贝塔系数；		
	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（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	5%	124,095,133.65	-
	-5%	-124,095,133.65	

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	2,520,084,935.11	86.18
	其中：股票	2,520,084,935.11	86.18
2	固定收益投资	803,564.30	0.03
	其中：债券	803,564.30	0.03
	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	213,834,922.07	7.31
7	其他各项资产	189,563,638.87	6.48
8	合计	2,924,287,060.35	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	21,902,620.00	0.81
B	采矿业	49,471,544.11	1.83
C	制造业	1,515,621,701.83	56.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	136,344,347.18	5.05
E	建筑业	40,804,373.08	1.51
F	批发和零售业	194,106,912.53	7.19
G	交通运输、仓储和邮政业	38,937,580.00	1.44
H	住宿和餐饮业	19,065,920.80	0.71
I	信息传输、软件和信息技术服务业	117,932,994.61	4.37
J	金融业	19,123,071.66	0.71
K	房地产业	206,192,120.09	7.64
L	租赁和商务服务业	32,947,159.26	1.22
M	科学研究和技术服务业	8,923,949.20	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	5,824,555.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	51,309,808.80	1.90
R	文化、体育和娱乐业	61,576,276.96	2.28
S	综合	-	-
	合计	2,520,084,935.11	93.38

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600578	京能电力	3,834,400	34,241,192.00	1.27
2	000039	中集集团	980,200	31,660,460.00	1.17
3	000732	泰禾集团	925,737	31,660,205.40	1.17
4	002475	立讯精密	921,635	31,160,479.35	1.15
5	300015	爱尔眼科	855,172	27,587,848.72	1.02

6	600066	宇通客车	1,276,200	26,225,910.00	0.97
7	600162	香江控股	2,228,900	26,144,997.00	0.97
8	000088	盐田港	1,830,100	25,914,216.00	0.96
9	000876	新希望	1,246,100	24,186,801.00	0.90
10	600674	川投能源	1,929,400	24,136,794.00	0.89
11	600426	华鲁恒升	1,292,100	23,981,376.00	0.89
12	002595	豪迈科技	1,080,670	23,320,858.60	0.86
13	300072	三聚环保	688,820	23,213,234.00	0.86
14	600219	南山铝业	2,272,000	22,924,480.00	0.85
15	600089	特变电工	1,546,700	22,906,627.00	0.85
16	600332	白云山	663,794	22,874,341.24	0.85
17	601678	滨化股份	2,542,200	22,803,534.00	0.85
18	002056	横店东磁	692,885	21,673,442.80	0.80
19	000529	广弘控股	1,343,441	21,454,752.77	0.80
20	600185	格力地产	655,427	21,137,520.75	0.78
21	000963	华东医药	293,696	20,993,390.08	0.78
22	600801	华新水泥	1,955,260	20,667,098.20	0.77
23	600648	外高桥	584,300	20,497,244.00	0.76
24	300134	大富科技	732,747	20,480,278.65	0.76
25	600885	宏发股份	653,039	20,466,242.26	0.76
26	600823	世茂股份	1,523,750	19,854,462.50	0.74
27	600266	北京城建	894,700	19,763,923.00	0.73
28	000402	金融街	1,396,541	19,733,124.33	0.73
29	002003	伟星股份	1,192,140	19,276,903.80	0.71
30	002202	金风科技	983,622	19,151,120.34	0.71
31	000671	阳光城	920,469	19,127,345.82	0.71
32	000563	陕国投 A	1,359,138	19,123,071.66	0.71
33	600754	锦江股份	639,796	19,065,920.80	0.71
34	600612	老凤祥	355,658	19,041,929.32	0.71
35	000792	盐湖股份	663,344	18,825,702.72	0.70
36	600261	阳光照明	2,288,500	18,605,505.00	0.69
37	300216	千山药机	380,600	18,580,892.00	0.69
38	600824	益民集团	1,833,612	18,207,767.16	0.67
39	600713	南京医药	1,106,100	18,140,040.00	0.67
40	600499	科达洁能	611,800	18,133,752.00	0.67
41	002065	东华软件	619,900	17,822,125.00	0.66
42	300207	欣旺达	731,613	17,719,666.86	0.66
43	002078	太阳纸业	2,138,500	17,108,000.00	0.63
44	002051	中工国际	573,500	17,078,830.00	0.63

45	300115	长盈精密	510,700	17,011,417.00	0.63
46	600197	伊力特	1,087,000	16,902,850.00	0.63
47	300347	泰格医药	485,334	16,559,596.08	0.61
48	600138	中青旅	758,200	16,013,184.00	0.59
49	002237	恒邦股份	1,327,000	15,884,190.00	0.59
50	002618	丹邦科技	372,116	15,788,881.88	0.59
51	601933	永辉超市	1,360,300	15,765,877.00	0.58
52	000568	泸州老窖	480,609	15,672,659.49	0.58
53	002681	奋达科技	567,740	15,590,140.40	0.58
54	600844	丹化科技	1,448,500	15,469,980.00	0.57
55	002267	陕天然气	995,502	15,420,325.98	0.57
56	000933	神火股份	1,635,900	15,410,178.00	0.57
57	002063	远光软件	492,657	15,405,384.39	0.57
58	300195	长荣股份	480,580	15,359,336.80	0.57
59	000650	仁和药业	892,500	15,324,225.00	0.57
60	300164	通源石油	872,880	14,961,163.20	0.55
61	300255	常山药业	429,765	14,917,143.15	0.55
62	601126	四方股份	486,100	14,826,050.00	0.55
63	600343	航天动力	435,600	14,801,688.00	0.55
64	600850	华东电脑	262,354	14,531,788.06	0.54
65	601012	隆基股份	922,900	14,526,446.00	0.54
66	300103	达刚路机	580,240	14,297,113.60	0.53
67	600098	广州发展	1,013,800	14,223,614.00	0.53
68	601607	上海医药	636,800	14,181,536.00	0.53
69	002146	荣盛发展	1,133,200	14,165,000.00	0.52
70	600409	三友化工	1,252,400	14,152,120.00	0.52
71	300156	神雾环保	323,598	14,073,277.02	0.52
72	000851	高鸿股份	816,800	14,057,128.00	0.52
73	600271	航天信息	216,800	14,029,128.00	0.52
74	300058	蓝色光标	882,400	13,950,744.00	0.52
75	002028	思源电气	753,760	13,869,184.00	0.51
76	002083	孚日股份	1,567,900	13,750,483.00	0.51
77	600737	中粮屯河	653,700	13,603,497.00	0.50
78	300133	华策影视	502,898	13,578,246.00	0.50
79	601222	林洋电子	384,900	13,506,141.00	0.50
80	000906	物产中拓	689,100	13,409,886.00	0.50
81	600687	刚泰控股	337,818	13,259,356.50	0.49
82	600633	浙报传媒	665,900	13,051,640.00	0.48
83	601519	大智慧	694,100	12,986,611.00	0.48

84	000028	国药一致	170,695	12,718,484.45	0.47
85	000807	云铝股份	1,544,700	12,697,434.00	0.47
86	600750	江中药业	394,452	12,697,409.88	0.47
87	600662	强生控股	855,600	12,457,536.00	0.46
88	300067	安诺其	1,088,820	12,325,442.40	0.46
89	000716	黑芝麻	519,009	12,295,323.21	0.46
90	300050	世纪鼎利	429,700	12,255,044.00	0.45
91	600551	时代出版	563,156	12,226,116.76	0.45
92	000543	皖能电力	571,500	12,207,240.00	0.45
93	002151	北斗星通	239,500	12,178,575.00	0.45
94	600884	杉杉股份	424,300	12,134,980.00	0.45
95	601179	中国西电	1,175,711	12,051,037.75	0.45
96	002281	光迅科技	249,400	11,991,152.00	0.44
97	002158	汉钟精机	498,920	11,974,080.00	0.44
98	002437	誉衡药业	411,550	11,955,527.50	0.44
99	002091	江苏国泰	455,600	11,945,832.00	0.44
100	002299	圣农发展	577,400	11,721,220.00	0.43
101	002568	百润股份	89,100	11,719,323.00	0.43
102	000903	云内动力	930,200	11,525,178.00	0.43
103	600320	振华重工	1,096,700	11,515,350.00	0.43
104	600630	龙头股份	733,700	11,489,742.00	0.43
105	600398	海澜之家	633,000	11,476,290.00	0.43
106	600587	新华医疗	195,700	11,473,891.00	0.43
107	600114	东睦股份	636,700	11,435,132.00	0.42
108	002311	海大集团	813,082	11,212,400.78	0.42
109	600584	长电科技	575,900	11,005,449.00	0.41
110	300140	启源装备	274,200	10,907,676.00	0.40
111	601231	环旭电子	626,800	10,661,868.00	0.40
112	600600	青岛啤酒	223,292	10,403,174.28	0.39
113	000713	丰乐种业	717,000	10,181,400.00	0.38
114	600056	中国医药	416,700	10,142,478.00	0.38
115	600563	法拉电子	325,100	10,061,845.00	0.37
116	600785	新华百货	459,600	10,060,644.00	0.37
117	000758	中色股份	511,307	10,036,956.41	0.37
118	002610	爱康科技	720,900	10,020,510.00	0.37
119	000601	韶能股份	1,066,088	9,967,922.80	0.37
120	600590	泰豪科技	564,236	9,800,779.32	0.36
121	002252	上海莱士	149,500	9,783,280.00	0.36
122	002195	二三四五	235,232	9,776,241.92	0.36

123	000898	鞍钢股份	1,328,900	9,700,970.00	0.36
124	002140	东华科技	426,300	9,532,068.00	0.35
125	002408	齐翔腾达	538,421	9,228,535.94	0.34
126	300056	三维丝	195,854	9,117,003.70	0.34
127	300202	聚龙股份	224,500	9,069,800.00	0.34
128	002042	华孚色纺	659,600	8,983,752.00	0.33
129	002045	国光电器	642,600	8,944,992.00	0.33
130	600525	长园集团	429,800	8,840,986.00	0.33
131	000531	穗恒运 A	629,700	8,815,800.00	0.33
132	002368	太极股份	134,361	8,803,332.72	0.33
133	000501	鄂武商 A	417,372	8,556,126.00	0.32
134	002271	东方雨虹	332,500	8,545,250.00	0.32
135	600340	华夏幸福	276,400	8,416,380.00	0.31
136	601515	东风股份	415,900	8,401,180.00	0.31
137	002014	永新股份	344,900	8,353,478.00	0.31
138	002185	华天科技	448,000	8,072,960.00	0.30
139	300381	溢多利	196,600	8,038,974.00	0.30
140	300357	我武生物	183,200	7,938,056.00	0.29
141	600456	宝钛股份	304,124	7,928,512.68	0.29
142	002457	青龙管业	503,800	7,904,622.00	0.29
143	002071	长城影视	368,700	7,779,570.00	0.29
144	000726	鲁泰 A	557,600	7,750,640.00	0.29
145	002557	洽洽食品	471,800	7,728,084.00	0.29
146	600622	嘉宝集团	555,400	7,697,844.00	0.29
147	002332	仙琚制药	424,100	7,345,412.00	0.27
148	600188	兖州煤业	528,100	7,261,375.00	0.27
149	002561	徐家汇	434,442	7,168,293.00	0.27
150	600763	通策医疗	64,900	7,162,364.00	0.27
151	000685	中山公用	240,700	7,083,801.00	0.26
152	601636	旗滨集团	656,700	7,046,391.00	0.26
153	600195	中牧股份	249,600	7,013,760.00	0.26
154	000961	中南建设	350,904	7,007,552.88	0.26
155	002405	四维图新	157,200	6,885,360.00	0.26
156	000902	新洋丰	250,738	6,807,536.70	0.25
157	002354	天神娱乐	69,800	6,768,506.00	0.25
158	002444	巨星科技	364,400	6,734,112.00	0.25
159	002423	中原特钢	409,300	6,610,195.00	0.24
160	002324	普利特	189,900	6,589,530.00	0.24
161	600208	新潮中宝	852,800	6,583,616.00	0.24

162	002433	太安堂	403,900	6,527,024.00	0.24
163	600967	北方创业	380,200	6,509,024.00	0.24
164	002005	德豪润达	564,200	6,477,016.00	0.24
165	600469	风神股份	354,500	6,409,360.00	0.24
166	600987	航民股份	472,500	6,407,100.00	0.24
167	601958	金钼股份	531,800	6,264,604.00	0.23
168	600604	市北高新	359,217	6,210,861.93	0.23
169	600803	新奥股份	351,900	6,021,009.00	0.22
170	002521	齐峰新材	428,804	5,968,951.68	0.22
171	002033	丽江旅游	376,750	5,824,555.00	0.22
172	601001	大同煤业	628,900	5,811,036.00	0.22
173	300150	世纪瑞尔	436,042	5,808,079.44	0.22
174	300238	冠昊生物	140,700	5,736,339.00	0.21
175	600657	信达地产	691,364	5,696,839.36	0.21
176	000528	柳工	471,400	5,571,948.00	0.21
177	000703	恒逸石化	436,100	5,564,636.00	0.21
178	300183	东软载波	195,200	5,563,200.00	0.21
179	600315	上海家化	126,500	5,490,100.00	0.20
180	300336	新文化	229,900	5,480,816.00	0.20
181	601098	中南传媒	238,300	5,459,453.00	0.20
182	002204	大连重工	404,700	5,406,792.00	0.20
183	600496	精工钢构	730,620	5,340,832.20	0.20
184	600497	驰宏锌锗	352,050	5,136,409.50	0.19
185	002585	双星新材	297,520	4,998,336.00	0.19
186	002469	三维工程	221,300	4,890,730.00	0.18
187	002020	京新药业	176,075	4,791,000.75	0.18
188	600509	天富能源	333,400	4,690,938.00	0.17
189	000623	吉林敖东	136,319	4,580,318.40	0.17
190	600366	宁波韵升	128,800	4,519,592.00	0.17
191	002479	富春环保	245,564	4,506,099.40	0.17
192	000825	太钢不锈	619,950	4,407,844.50	0.16
193	000919	金陵药业	214,000	4,168,720.00	0.15
194	600729	重庆百货	129,000	4,151,220.00	0.15
195	300148	天舟文化	186,240	4,000,435.20	0.15
196	000768	中航飞机	90,400	3,939,632.00	0.15
197	600387	海越股份	152,692	3,896,699.84	0.14
198	600879	航天电子	154,700	3,790,150.00	0.14
199	002048	宁波华翔	166,600	3,463,614.00	0.13
200	300196	长海股份	95,200	3,371,032.00	0.12

201	600990	四创电子	32,200	3,101,504.00	0.11
202	600645	中源协和	38,700	3,070,458.00	0.11
203	002400	省广股份	118,101	2,983,231.26	0.11
204	601799	星宇股份	76,500	2,925,360.00	0.11
205	300224	正海磁材	128,249	2,704,771.41	0.10
206	002372	伟星新材	143,260	2,545,730.20	0.09
207	002586	围海股份	148,200	1,845,090.00	0.07
208	000786	北新建材	72,000	1,337,760.00	0.05
209	600461	洪城水业	80,200	1,050,620.00	0.04
210	002268	卫士通	8,600	689,204.00	0.03
211	300294	博雅生物	8,200	646,406.00	0.02
212	300113	顺网科技	11,000	634,700.00	0.02
213	002116	中国海诚	31,720	609,341.20	0.02
214	000022	深赤湾 A	21,200	565,828.00	0.02
215	002264	新华都	38,100	356,235.00	0.01
216	300008	上海佳豪	20,500	353,420.00	0.01
217	002626	金达威	7,200	141,696.00	0.01
218	600845	宝信软件	48	3,418.08	0.00
219	002419	天虹商场	30	510.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002475	立讯精密	39,858,366.63	1.48
2	000732	泰禾集团	33,937,670.03	1.26
3	600578	京能电力	32,948,827.95	1.22
4	002056	横店东磁	31,555,170.30	1.17
5	300015	爱尔眼科	31,426,095.14	1.16
6	300134	大富科技	31,045,774.99	1.15
7	000529	广弘控股	29,887,609.50	1.11
8	000876	新希望	29,722,554.99	1.10
9	600089	特变电工	29,328,928.58	1.09
10	600219	南山铝业	29,302,459.50	1.09
11	002595	豪迈科技	28,778,431.01	1.07

12	000028	国药一致	27,981,484.25	1.04
13	600332	白云山	27,731,940.31	1.03
14	600066	宇通客车	27,533,016.42	1.02
15	601678	滨化股份	27,411,137.07	1.02
16	601012	隆基股份	27,371,383.91	1.01
17	600340	华夏幸福	26,168,130.68	0.97
18	600801	华新水泥	26,113,688.17	0.97
19	300072	三聚环保	25,989,263.66	0.96
20	300204	舒泰神	25,969,519.86	0.96

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000997	新大陆	38,000,484.58	1.41
2	300204	舒泰神	37,290,739.33	1.38
3	000030	富奥股份	23,409,345.37	0.87
4	002073	软控股份	22,311,616.09	0.83
5	600487	亨通光电	22,007,478.11	0.82
6	000839	中信国安	21,300,860.80	0.79
7	600239	云南城投	20,213,890.88	0.75
8	600340	华夏幸福	18,246,899.81	0.68
9	000759	中百集团	17,068,451.21	0.63
10	600488	天药股份	16,784,843.25	0.62
11	000878	云南铜业	16,638,810.16	0.62
12	000600	建投能源	16,341,650.15	0.61
13	601801	皖新传媒	16,148,496.21	0.60
14	600460	士兰微	15,767,598.80	0.58
15	600368	五洲交通	15,631,696.44	0.58
16	002331	皖通科技	15,613,476.06	0.58
17	600305	恒顺醋业	15,393,054.96	0.57
18	300043	互动娱乐	15,235,323.00	0.56
19	600521	华海药业	14,934,429.85	0.55
20	002262	恩华药业	14,863,908.06	0.55

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	4,350,980,961.36
卖出股票收入（成交）总额	2,229,521,166.77

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	803,564.30	0.03
8	其他	-	-
9	合计	803,564.30	0.03

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	5,530	803,564.30	0.03

### 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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	494,649.93
2	应收证券清算款	171,310,757.12
3	应收股利	-
4	应收利息	48,955.72
5	应收申购款	17,709,276.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	189,563,638.87

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000732	泰禾集团	31,660,205.40	1.17	重大事项停牌

## §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
59,517	35,075.36	10,216,793.19	0.49%	2,077,363,503.42	99.51%

### 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	206,350.58	0.0100%

### 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( 2015 年 2 月 16 日 ) 基金份额总额	1,903,140,954.30
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,277,810,435.17
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,093,371,092.86

本报告期末基金份额总额	2,087,580,296.61
-------------	------------------

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，基金托管人中国工商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	
上海证券	1	-	-	15,065.86	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	52,022.70	-	-
国信证券	1	-	-	176,040.44	-	-
中信建投	1	-	-	222,399.35	-	-
东方证券	2	-	-	2,302,303.28	-	-
华鑫证券	1	-	-	6,325.26	-	-
长江证券	1	-	-	363,333.20	-	-
安信证券	1	-	-	668,287.33	-	-
东兴证券	1	-	-	9,224.60	-	-
齐鲁证券	2	-	-	41,194.82	-	-
国金证券	2	-	-	618,842.80	-	-
兴业证券	2	-	-	390,370.91	-	-
中投证券	1	-	-	57,598.62	-	-
联合证券	2	-	-	90,085.02	-	-
银河证券	2	-	-	581,809.52	-	-
海通证券	1	-	-	200,342.42	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

方正证券	1	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	99,267.09	-

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
上海证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

广州证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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 43 个交易单元与汇添富成长焦点股票型证券投资基金共用。本报告期退租 1 家证券公司的 1 个交易单元：厦门证券（上交所交易单元）。



## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富成长多因子量化策略股票型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	2015 年 1 月 30 日
2	汇添富成长多因子量化策略股票型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	2015 年 1 月 30 日
3	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摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 1 月 30 日
4	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	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 1 月 30 日
5	汇添富成长多因子量化策略股票型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	2015 年 1 月 30 日
6	关于汇添富成长多因子量化策略股票基金通过网上直销认购费率优惠的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 1 月 31 日
7	关于汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金增加江苏银行为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 2 月 4 日
8	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生效公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 2 月 17 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中信建投期货为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 6 日

10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与数米基金开展的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	2015 年 3 月 9 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于开展现金宝用户销售活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 10 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与齐鲁证券开展的网上交易系统申购基金购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 11 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加苏州银行为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 26 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行个人电子银行申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 28 日
15	汇添富基金管理股份有限公司北京分公司办公地址变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 31 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于数米基金调整基金申购最低优惠费率的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 4 日
17	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 4 日
18	汇添富基金管理股份有限公司关	中国证券报, 上海证	2015 年 4 月 17 日

	于高级管理人员变更的公告（总经理、法人变更）	券报, 证券时报, 管理人网站	
19	汇添富基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告（董事长变更）	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 17 日
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加汇付天下为销售机构并参与费率优惠活动的公告(自 TA 产品)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 18 日
21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加海银基金为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 18 日
22	汇添富基金管理股份有限公司关于董事会成员变更的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 18 日
23	关于汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、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	2015 年 5 月 7 日
24	关于汇添富成长多因子量化策略股票证券投资基金参加部分代销机构定投基金、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	2015 年 5 月 7 日
25	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告（卫士通）	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 5 月 12 日
26	汇添富基金管理股份有限公司关于养老金账户通过直销中心申购	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管	2015 年 5 月 13 日

	旗下部分基金费率优惠的公告	理人网站	
27	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加恒丰银行为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 5 月 16 日
28	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告 (博雅生物)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 5 月 28 日
29	汇添富基金管理股份有限公司关于开展现金宝用户销售活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 6 月 5 日
30	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加鹿城农商银行为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 6 月 24 日
31	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的网上银行、手机银行申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 6 月 26 日
32	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加龙湾农商行为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 6 月 26 日
33	汇添富基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 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成长多因子量化策略股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《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》；
- 3、《汇添富成长多因子量化策略股票型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、报告期内汇添富成长多因子量化策略股票型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  
2015 年 8 月 29 日