

# 汇添富移动互联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 1 月 1 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.....	11
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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	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.....	13
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.....	13
<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.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	40

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	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.....	41
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>41</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	46
<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.....	53
11.3 查阅方式.....	53

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富移动互联股票型证券投资基金
基金简称	汇添富移动互联股票
基金主代码	000697
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月26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	2,914,445,538.28份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，精选移动互联主题的优质上市公司，结合市场脉络，做中长期布局，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金采用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；个股精选策略用于发掘移动互联主题相关的上市公司中商业模式独特、竞争优势明显，具有长期持续增长模式、估值水平相对合理的优质上市公司。
业绩比较基准	中证移动互联网指数×80%+中债综合指数×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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	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	北京市西城区复兴门内大街 55

	号 6 栋 538 室	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	李文	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 楼 汇添富基金管理股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,297,075,398.04
本期利润	4,419,473,867.98
加权平均基金份额本期利润	1.2614
本期加权平均净值利润率	52.02%
本期基金份额净值增长率	110.94%
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	2,043,839,315.83
期末可供分配基金份额利润	0.7013
期末基金资产净值	7,138,210,303.48
期末基金份额净值	2.449
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	144.90%

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(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

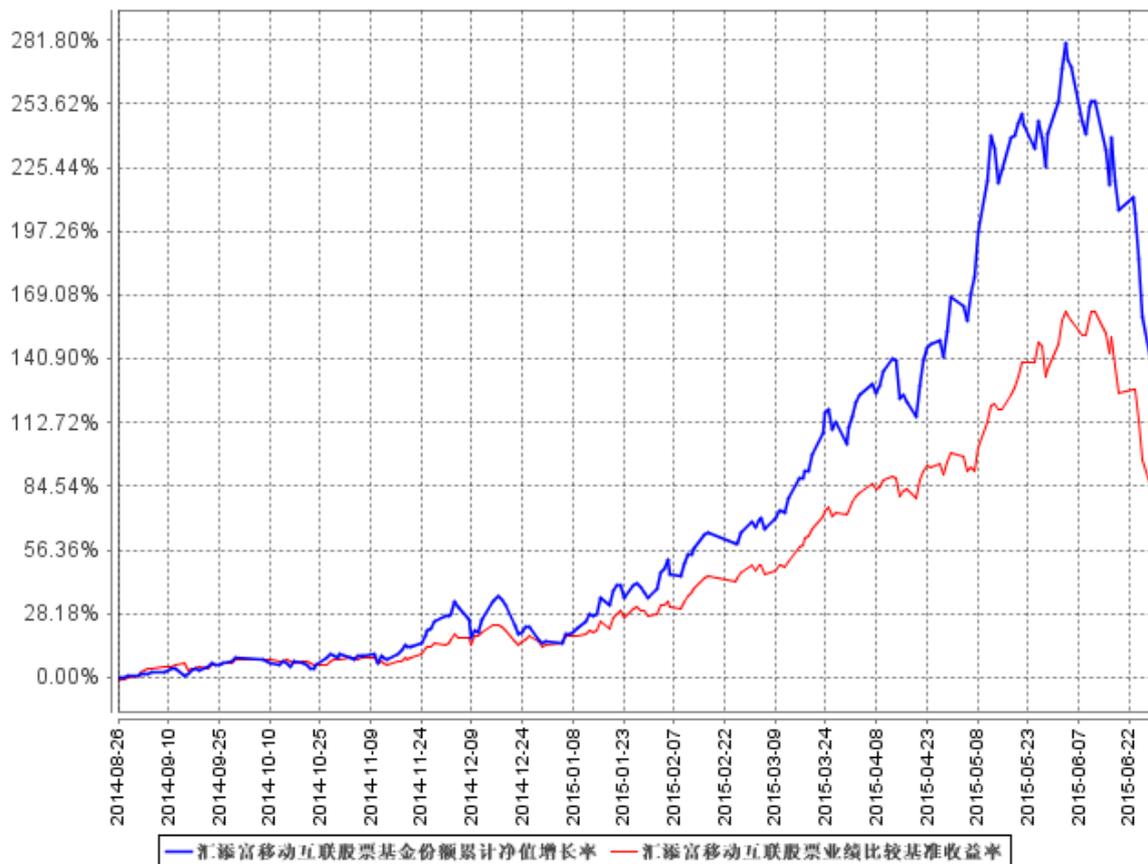
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-28.08%	4.79%	-16.19%	3.61%	-11.89%	1.18%
过去三个月	16.40%	4.11%	10.19%	2.75%	6.21%	1.36%
过去六个月	110.94%	3.47%	66.42%	2.25%	44.52%	1.22%
自基金合同生效日起至 今	144.90%	2.97%	92.83%	1.87%	52.07%	1.10%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2014 年 08 月 26 日，至本报告期末未满 1 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

汇添富移动互联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：本基金的《基金合同》生效日为 2014 年 8 月 26 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为自《基金合同》生效之日(2014 年 8 月 26 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		
欧阳沁春	汇添富社会责任股票基金、汇添富移	2014 年 8 月 26 日	-	14 年	国籍：中国。学历：卫生部武汉生物制

	<p>动互联股票基金的基金经理。</p>			<p>品研究所医学硕士、中欧国际工商学院工商管理硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任卫生部武汉生物制品研究所助理研究员、中国网络（百慕大）有限公司项目经理、大成基金管理有限公司行业研究员、国联安基金管理有限公司行业研究员，2006 年 9 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，2007 年 6 月 18 日至 2012 年 3 月 2 日任汇添富均衡增长股票基金的基金</p>
--	----------------------	--	--	--

					经理， 2011 年 3 月 29 日 至今任汇 添富社会 责任股票 基金的基 金经理， 2014 年 8 月 26 日 至今任汇 添富移动 互联股票 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

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

上半年的 A 股市场大幅上扬：上证指数在六月份后冲高后回落，上半年上涨 32.23%，创业板指数更是波动极大，上涨 94.23%，但是已经从高点回落 29.2%。市场表现分化十分严重：计算机、轻工制造、传媒等行业表现突出，而非银金融、银行和有色金属等行业表现相对疲弱。

2015 年年初我们判断这是一轮比较好的投资机会，我们一直在高仓位运作，但是市场波动的幅度远超我们的预期，巨额的申赎和产品的性质也影响了我们对于仓位的选择，我们经历了市场大幅上涨，也承受了比较大的回撤。在行业配置方面：我们在互联网各个相关的行业做了全面的布局，我们在智慧医疗、互联网电商与互联网金融、互联网农业、供应链金融做了比较多的投资。由于本期市场波动比较大，6 月份下旬开始本基金的收益回撤比较多。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期的收益率为 110.94%，比业绩比较基准高 44.52 个百分点。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年下半年，我们依然认为市场有结构性投资机会，经过市场的大幅调整，很多股票跌幅超过 5 成，部分股票已经凸显了投资价值：我们认为国企改革的红利有望持续推动股指、资本市场的改革与创新也是重要推动因素、居民财富的再分配也是牛市形成的主要推动力之一。总体而言，股市在波折中不断前行，依然存在不少比较好的投资机会。在目前阶段那些真正有核心竞争力、长期发展前景，商业模式可持续以及具有企业家精神的企业能够经受住市场的考验，强者恒强的企业实现真正的成长，成为长期牛股。而移动互联板块的行情正在逐步展开，是布局的好时机。随着互联网终端从 PC 向移动端的迁移、消费者习惯逐步养成，移动互联行业的成长空间巨大，互联网的影响正在从浅层次的影响到深层次革命性改变与颠覆传统的行业。新的商业模式层出不穷，正是这种改变会催生出一批市值百亿、千亿的公司。我们会重点考虑互联网金融、

互联网电商、互联网医疗及信息安全的投资机会。

#### 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移动互联股票型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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，汇添富移动互联股票型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富移动互联股票型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。本报告期内，汇添富移动互联股票型证券投资基金未进行利润分配。

## 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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富移动互联股票型证券投资基金 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：汇添富移动互联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	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	443,879,401.64	107,227,740.96
结算备付金		24,643,988.48	3,869,270.17
存出保证金		3,483,744.61	854,685.53
交易性金融资产	6.4.7.2	6,662,072,988.36	1,992,329,393.67
其中：股票投资		6,661,789,633.86	1,992,329,393.67
基金投资		-	-
债券投资		283,354.50	-
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		631,667,820.79	-
应收利息	6.4.7.5	139,952.14	49,654.77

应收股利		-	-
应收申购款		26,853,870.88	44,273,898.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,792,741,766.90	2,148,604,643.69
<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>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		622,646,193.60	12,667,078.42
应付管理人报酬		16,235,742.90	2,306,697.99
应付托管费		2,705,957.15	384,449.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	11,816,747.84	3,899,915.25
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	1,126,821.93	184,567.79
负债合计		654,531,463.42	19,442,709.11
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,914,445,538.28	1,834,101,019.53
未分配利润	6.4.7.10	4,223,764,765.20	295,060,915.05
所有者权益合计		7,138,210,303.48	2,129,161,934.58
负债和所有者权益总计		7,792,741,766.90	2,148,604,643.69

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.449 元，基金份额总额

2,914,445,538.28 份。

2、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：汇添富移动互联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	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
<b>一、收入</b>		4,527,557,902.07
1.利息收入		3,285,528.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,280,841.32

债券利息收入		16.24
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		4,670.93
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,234,331,533.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,225,548,804.29
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	8,782,728.85
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,122,398,469.94
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	167,542,370.50
<b>减：二、费用</b>		108,084,034.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	61,694,742.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,282,457.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	35,909,886.44
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	196,947.93
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,419,473,867.98

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、本基金于 2014 年 8 月 26 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示本报告期数据，特此说明。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富移动互联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	1,834,101,019.53	295,060,915.05	2,129,161,934.58

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,419,473,867.98	4,419,473,867.98
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)	1,080,344,518.75	-490,770,017.83	589,574,500.92
其中：1.基金申购款	12,880,737,652.24	15,231,932,539.75	28,112,670,191.99
2.基金赎回款	-11,800,393,133.49	-15,722,702,557.58	-27,523,095,691.07
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)	2,914,445,538.28	4,223,764,765.20	7,138,210,303.48

注：本基金于 2014 年 8 月 26 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）变动表只列示本报告期数据，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

汇添富移动互联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[2014]523 号文《关于核准汇添富移动互联股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由汇添富基金管理股份有限公司作为发起人于 2014 年 7 月 28 日至 2014 年 8 月 22 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具(2014)验字第 60466941\_B21 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2014 年 8 月 26 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 1,659,912,659.92 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 447,949.54 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 1,660,360,609.46 元，折合 1,660,360,609.46 份基金份额。本基金的基金管理人及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(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、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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金采用自下而上的投资方法,以基本面分析为立足点,精选移动互联主题的优质上市公司,结合市场脉络,做中长期布局,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期稳健增值。本基金业绩比较基准为中证移动互联网指数×80%+中债综合指数×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。

#### 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1月1日至2015年6月30日止期间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

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。

#### 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。

#### 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 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	443,879,401.64
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	443,879,401.64

#### 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	4,504,361,912.50	6,661,789,633.86	2,157,427,721.36
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	283,354.50	88,354.50
	银行间市场	-	-
	合计	283,354.50	88,354.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,504,556,912.50	6,662,072,988.36	2,157,516,075.86

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 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	128,544.15
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	9,980.82
应收债券利息	16.24
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	1,410.93
合计	139,952.14

注：“其他”为结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 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	11,816,747.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,816,747.84

#### 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	858,384.64
预提审计费	119,671.58
预提信息披露费	148,765.71
合计	1,126,821.93

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,834,101,019.53	1,834,101,019.53
本期申购	12,880,737,652.24	12,880,737,652.24
本期赎回(以“-”号填列)	-11,800,393,133.49	-11,800,393,133.49
- 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	2,914,445,538.28	2,914,445,538.28

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
上年度末	152,118,220.05	142,942,695.00	295,060,915.05
本期利润	2,297,075,398.04	2,122,398,469.94	4,419,473,867.98
本期基金份额交易产生的变动数	-405,354,302.26	-85,415,715.57	-490,770,017.83
其中：基金申购款	3,585,957,911.31	11,645,974,628.44	15,231,932,539.75
基金赎回款	-3,991,312,213.57	-11,731,390,344.01	-15,722,702,557.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,043,839,315.83	2,179,925,449.37	4,223,764,765.20

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	179,348.80
其他	84,690.86
合计	3,280,841.32

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 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	11,845,557,209.31
减：卖出股票成本总额	9,620,008,405.02
买卖股票差价收入	2,225,548,804.29

### 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：本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期末有贵金属投资收益。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期末有衍生工具收益。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,782,728.85
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,782,728.85

### 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 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,122,398,469.94
——股票投资	2,122,310,115.44
——债券投资	88,354.50
——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	2,122,398,469.94

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	167,542,370.50
合计	167,542,370.50

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	35,909,886.44
银行间市场交易费用	-
合计	35,909,886.44

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
银行划款费用	1,010.64
帐户维护费	7,500.00
合计	196,947.93

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

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

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、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
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

## 6.4.10 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1月1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	6,512,749,825.18	27.12%

#### 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	5,800,177.62	27.12%	1,615,792.01	13.67%

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1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	61,694,742.61
其中：支付销售机构的客户维护费	23,390,484.81

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：

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

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	10,282,457.11

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，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首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

### 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的债券(含回购)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本报告期及上年度可比期间均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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
东方证券股份有限公司	19,999,000.00	0.69%	19,999,000.00	1.09%

注：东方证券股份有限公司于 2014 年 8 月 22 日运用 20,000,000.00 元认购本基金份额 19,999,000.00 份（含募集期利息结转的份额），认购费用为 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 1 月 1 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	443,879,401.64	3,016,801.66

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 上半年期间获得的利息收入为人民币 196,861.77 元，2015 年末结算备付金余额为人民币 28,127,733.09 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：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 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：本基金本报告期末进行利润分配。

#### 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：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
300291	华录百纳	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	37.76	2015 年 7 月 13 日	34.65	9,090,840	318,499,569.88	343,270,118.40	-
300028	金亚科技	2015 年 6 月 10 日	重大事项停牌	34.51	-	-	6,583,822	255,193,639.95	227,207,697.22	-
300377	赢时胜	2015 年 5 月 20 日	重大事项停牌	187.77	2015 年 7 月 15 日	168.99	374,245	45,737,181.00	70,271,983.65	-
300255	常山药业	2015 年 6 月 3 日	重大事项停牌	34.71	2015 年 7 月 13 日	31.24	1,999,931	44,581,075.48	69,417,605.01	-
002649	博彦科技	2015 年 6 月 1 日	重大事项停牌	83.81	2015 年 8 月 18 日	75.43	54,259	2,471,100.42	4,547,446.79	-

002170	芭田股份	2015年5月26日	重大事项停牌	26.12	2015年7月28日	23.51	12,259	112,364.33	320,205.08	-
300383	光环新网	2015年6月17日	重大资产重组停牌	73.08	-	-	2,999,882	86,911,050.19	219,231,376.56	-

### 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

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金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

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金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。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，

因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 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	283,354.50	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	283,354.50	-

#### 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、存出保证金及部分应收申购款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	443,879,401.64	-	-	-	-	-	443,879,401.64
结算备付金	24,643,988.48	-	-	-	-	-	24,643,988.48
存出保证金	3,483,744.61	-	-	-	-	-	3,483,744.61
交易性金融资产	-	283,354.50	-	-	-	6,661,789,633.86	6,662,072,988.36
应收证券清算款	-	-	-	-	-	631,667,820.79	631,667,820.79
应收利息	-	-	-	-	-	139,952.14	139,952.14
应收申购款	3,216,711.92	-	-	-	-	23,637,158.96	26,853,870.88
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	475,223,846.65	283,354.50	-	-	-	7,317,234,565.75	7,792,741,766.90
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	622,646,193.60	622,646,193.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	16,235,742.90	16,235,742.90
应付托管费	-	-	-	-	-	2,705,957.15	2,705,957.15
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,816,747.84	11,816,747.84
其他负债	-	-	-	-	-	1,126,821.93	1,126,821.93
负债总计	-	-	-	-	-	654,531,463.42	654,531,463.42
利率敏感度缺口	475,223,846.65	283,354.50	-	-	-	6,662,703,102.33	7,138,210,303.48
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	107,227,740.96	-	-	-	-	-	107,227,740.96
结算备付金	3,869,270.17	-	-	-	-	-	3,869,270.17
存出保证金	854,685.53	-	-	-	-	-	854,685.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,992,329,393.67	1,992,329,393.67
应收利息	-	-	-	-	-	49,654.77	49,654.77
应收申购款	2,402,289.15	-	-	-	-	41,871,609.44	44,273,898.59
资产总计	114,353,985.81	-	-	-	-	2,034,250,657.88	2,148,604,643.69
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,667,078.42	12,667,078.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,306,697.99	2,306,697.99
应付托管费	-	-	-	-	-	384,449.66	384,449.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,899,915.25	3,899,915.25
其他负债	-	-	-	-	-	184,567.79	184,567.79
负债总计	-	-	-	-	-	19,442,709.11	19,442,709.11
利率敏感度缺口	114,353,985.81	-	-	-	-	2,014,807,948.77	2,129,161,934.58

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，

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

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股票，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	6,661,789,633.86	93.33	1,992,329,393.67	93.57
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	283,354.50	0.00	-	-
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	6,662,072,988.36	93.33	1,992,329,393.67	93.57

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）
	中证移动互联网指数上涨 5%	409,101,584.25	96,933,613.91
	中证移动互联网指数下跌 5%	-409,101,584.25	-96,933,613.91

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	6,661,789,633.86	85.49
	其中：股票	6,661,789,633.86	85.49
2	固定收益投资	283,354.50	0.00
	其中：债券	283,354.50	0.00
	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	468,523,390.12	6.01
7	其他各项资产	662,145,388.42	8.50
8	合计	7,792,741,766.90	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,352,074,384.71	18.94
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	4,891,140.97	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	81,147,690.12	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,717,364,658.26	66.09
J	金融业	-	-
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	163,041,641.40	2.28
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	343,270,118.40	4.81
S	综合	-	-
	合计	6,661,789,633.86	93.33

## 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	002657	中金金财	7,101,449	653,475,336.98	9.15
2	300033	同花顺	7,178,109	617,245,592.91	8.65
3	300168	万达信息	11,753,314	577,322,783.68	8.09
4	300085	银之杰	7,522,084	539,559,085.32	7.56
5	002175	广陆数测	9,434,980	523,641,390.00	7.34

6	300380	安硕信息	4,354,574	474,866,294.70	6.65
7	600446	金证股份	3,500,280	432,144,568.80	6.05
8	300170	汉得信息	16,312,351	396,227,005.79	5.55
9	300291	华录百纳	9,090,840	343,270,118.40	4.81
10	002584	西陇化工	8,674,501	317,486,736.60	4.45
11	300348	长亮科技	2,868,290	315,511,900.00	4.42
12	300028	金亚科技	6,583,822	227,207,697.22	3.18
13	300378	鼎捷软件	2,732,107	221,683,161.98	3.11
14	300383	光环新网	2,999,882	219,231,376.56	3.07
15	300384	三联虹普	1,663,860	163,041,641.40	2.28
16	000158	常山股份	5,143,721	112,647,489.90	1.58
17	600570	恒生电子	840,018	94,124,016.90	1.32
18	300240	飞力达	4,200,191	81,147,690.12	1.14
19	300377	赢时胜	374,245	70,271,983.65	0.98
20	300255	常山药业	1,999,931	69,417,605.01	0.97
21	300166	东方国信	1,452,371	52,169,166.32	0.73
22	002090	金智科技	1,218,422	35,943,449.00	0.50
23	002489	浙江永强	680,548	25,656,659.60	0.36
24	000948	南天信息	672,172	25,004,798.40	0.35
25	300016	北陆药业	395,981	16,912,348.51	0.24
26	300271	华宇软件	369,500	16,187,795.00	0.23
27	300399	京天利	52,404	7,552,464.48	0.11
28	002363	隆基机械	198,664	6,716,829.84	0.09
29	002649	博彦科技	54,259	4,547,446.79	0.06
30	002030	达安基因	77,030	3,412,429.00	0.05
31	300298	三诺生物	88,432	3,405,516.32	0.05
32	002383	合众思壮	72,295	3,269,902.85	0.05
33	600478	科力远	180,000	3,063,600.00	0.04
34	300354	东华测试	82,387	2,928,033.98	0.04
35	600180	瑞茂通	99,947	2,864,481.02	0.04
36	300413	快乐购	43,631	2,026,659.95	0.03
37	002170	芭田股份	12,259	320,205.08	0.00
38	300290	荣科科技	6,000	239,880.00	0.00
39	300220	金运激光	777	42,268.80	0.00
40	000816	智慧农业	180	1,861.20	0.00
41	300205	天喻信息	12	361.80	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	600446	金证股份	746,023,795.86	35.04
2	600570	恒生电子	632,811,884.50	29.72
3	300226	上海钢联	592,719,383.60	27.84
4	300033	同花顺	565,905,965.92	26.58
5	002175	东方网络	447,751,240.19	21.03
6	002152	广电运通	431,943,659.50	20.29
7	300085	银之杰	431,266,227.05	20.26
8	002584	西陇化工	413,171,682.45	19.41
9	300170	汉得信息	378,346,237.02	17.77
10	300291	华录百纳	318,499,569.88	14.96
11	300352	北信源	307,208,500.31	14.43
12	300059	东方财富	305,797,093.92	14.36
13	300028	金亚科技	303,000,366.81	14.23
14	600711	盛屯矿业	301,807,368.69	14.17
15	002055	得润电子	278,373,957.27	13.07
16	300212	易华录	260,370,952.74	12.23
17	002121	科陆电子	245,108,773.02	11.51
18	000158	常山股份	218,908,732.97	10.28
19	300168	万达信息	217,607,176.72	10.22
20	600410	华胜天成	217,547,997.96	10.22
21	002649	博彦科技	210,678,583.02	9.89
22	002657	中科金财	203,999,160.48	9.58
23	300384	三联虹普	185,289,991.00	8.70
24	300378	鼎捷软件	183,940,590.00	8.64
25	300245	天玑科技	180,708,328.84	8.49
26	002030	达安基因	176,518,090.07	8.29
27	300113	顺网科技	166,983,853.48	7.84
28	300205	天喻信息	161,117,729.04	7.57
29	300367	东方网力	147,453,185.56	6.93
30	300348	长亮科技	144,256,178.33	6.78
31	300209	天泽信息	142,875,702.37	6.71

32	000876	新希望	128,366,665.93	6.03
33	600271	航天信息	120,512,770.15	5.66
34	300413	快乐购	120,293,750.07	5.65
35	002095	生意宝	105,149,516.51	4.94
36	300240	飞力达	102,382,680.90	4.81
37	300166	东方国信	101,905,201.03	4.79
38	002539	新都化工	93,658,178.85	4.40
39	000861	海印股份	93,649,806.10	4.40
40	600493	凤竹纺织	90,279,026.51	4.24
41	002489	浙江永强	87,972,553.92	4.13
42	300383	光环新网	86,911,050.19	4.08
43	002063	远光软件	85,654,906.24	4.02
44	002236	大华股份	81,936,198.41	3.85
45	300298	三诺生物	72,667,678.10	3.41
46	002469	三维工程	66,314,494.66	3.11
47	300354	东华测试	65,394,541.68	3.07
48	600687	刚泰控股	61,325,536.77	2.88
49	300377	赢时胜	61,105,323.55	2.87
50	601336	新华保险	59,048,900.76	2.77
51	300223	北京君正	58,814,295.68	2.76
52	300350	华鹏飞	57,475,212.39	2.70
53	601318	中国平安	57,339,192.98	2.69
54	300380	安硕信息	56,670,082.55	2.66
55	002090	金智科技	55,872,524.68	2.62
56	300220	金运激光	55,348,878.32	2.60
57	002363	隆基机械	54,408,709.01	2.56
58	600219	南山铝业	53,117,591.12	2.49
59	300255	常山药业	44,581,075.48	2.09
60	300287	飞利信	42,680,829.63	2.00

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超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	300226	上海钢联	720,081,834.44	33.82

2	300059	东方财富	702,322,853.88	32.99
3	300033	同花顺	646,145,535.13	30.35
4	600570	恒生电子	572,440,417.97	26.89
5	600446	金证股份	503,129,425.80	23.63
6	300352	北信源	462,428,608.14	21.72
7	002657	中科金财	452,233,738.98	21.24
8	002152	广电运通	407,176,199.40	19.12
9	600711	盛屯矿业	343,645,274.69	16.14
10	002649	博彦科技	306,381,500.40	14.39
11	002055	得润电子	304,242,747.89	14.29
12	300212	易华录	286,491,327.73	13.46
13	002121	科陆电子	271,137,008.43	12.73
14	600410	华胜天成	215,461,985.91	10.12
15	601318	中国平安	205,444,207.54	9.65
16	000948	南天信息	196,220,769.54	9.22
17	300205	天喻信息	190,915,146.50	8.97
18	002030	达安基因	189,011,720.69	8.88
19	300245	天玑科技	187,655,538.61	8.81
20	300367	东方网力	178,412,117.88	8.38
21	300113	顺网科技	170,638,265.87	8.01
22	002095	生意宝	146,270,201.56	6.87
23	601166	兴业银行	143,512,771.12	6.74
24	002363	隆基机械	138,181,344.56	6.49
25	300166	东方国信	132,676,139.82	6.23
26	000876	新希望	132,166,782.54	6.21
27	300209	天泽信息	129,140,579.10	6.07
28	600271	航天信息	125,369,062.27	5.89
29	300170	汉得信息	123,590,138.77	5.80
30	300168	万达信息	118,905,638.20	5.58
31	300413	快乐购	107,894,157.00	5.07
32	600661	新南洋	106,320,481.13	4.99
33	601336	新华保险	101,213,711.97	4.75
34	002063	远光软件	93,991,515.64	4.41
35	000861	海印股份	91,740,414.21	4.31
36	600493	凤竹纺织	91,408,040.41	4.29
37	002183	怡亚通	87,983,331.10	4.13
38	002236	大华股份	86,673,327.48	4.07
39	300085	银之杰	84,128,118.74	3.95

40	300350	华鹏飞	83,938,076.93	3.94
41	002539	新都化工	81,429,487.39	3.82
42	300240	飞力达	81,173,414.87	3.81
43	600158	中体产业	79,196,599.60	3.72
44	002584	西陇化工	72,914,124.93	3.42
45	002489	浙江永强	72,696,420.58	3.41
46	300298	三诺生物	70,979,785.97	3.33
47	600184	光电股份	69,914,041.35	3.28
48	002469	三维工程	67,799,740.10	3.18
49	300354	东华测试	67,244,693.00	3.16
50	601601	中国太保	66,906,134.17	3.14
51	300028	金亚科技	66,249,954.97	3.11
52	300231	银信科技	65,837,286.02	3.09
53	300380	安硕信息	65,573,707.34	3.08
54	300223	北京君正	61,660,148.00	2.90
55	300220	金运激光	61,258,492.76	2.88
56	300287	飞利信	60,136,396.90	2.82
57	600687	刚泰控股	59,795,576.74	2.81
58	002396	星网锐捷	58,425,529.79	2.74
59	300131	英唐智控	58,026,706.67	2.73
60	600219	南山铝业	56,530,979.37	2.66
61	000046	泛海控股	51,651,548.31	2.43
62	000158	常山股份	50,329,840.40	2.36
63	601328	交通银行	45,803,043.47	2.15
64	600180	瑞茂通	44,973,412.00	2.11
65	300384	三联虹普	44,025,246.05	2.07

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	12,167,158,529.77
卖出股票收入（成交）总额	11,845,557,209.31

### 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	283,354.50	0.00
8	其他	-	-
9	合计	283,354.50	0.00

### 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	1,950	283,354.50	0.00

### 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

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

本基金本报告期末未有国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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、处罚的情形。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,483,744.61
2	应收证券清算款	631,667,820.79
3	应收股利	-
4	应收利息	139,952.14
5	应收申购款	26,853,870.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	662,145,388.42

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	300291	华录百纳	343,270,118.40	4.81	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
553,702	5,263.56	327,455,930.93	11.24%	2,586,989,607.35	88.76%

### 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	3,228,513.37	0.11%

### 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	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年8月26日）基金份额总额	1,660,360,609.46
本报告期期初基金份额总额	1,834,101,019.53
本报告期基金总申购份额	12,880,737,652.24
减：本报告期基金总赎回份额	11,800,393,133.49
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	2,914,445,538.28

注：其中“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	
东方证券	2	6,512,749,825.18	27.12%	5,800,177.62	27.12%	-
国金证券	2	4,163,573,643.62	17.34%	3,684,783.46	17.23%	-
中信证券	1	2,822,097,440.98	11.75%	2,497,275.31	11.68%	-
国泰君安	1	2,644,158,813.86	11.01%	2,339,816.47	10.94%	-
东北证券	2	1,921,470,444.09	8.00%	1,702,561.58	7.96%	-
长城证券	1	1,128,758,092.23	4.70%	1,027,626.32	4.80%	-
国信证券	2	1,086,715,331.14	4.53%	965,374.50	4.51%	-
长江证券	1	723,626,034.92	3.01%	658,787.87	3.08%	-
齐鲁证券	1	613,555,778.28	2.56%	542,934.29	2.54%	-
国海证券	2	612,097,664.79	2.55%	557,252.60	2.61%	-
恒泰证券	2	447,272,387.50	1.86%	401,439.18	1.88%	-
中投证券	1	442,460,255.90	1.84%	402,814.07	1.88%	-
联合证券	1	365,116,374.19	1.52%	332,398.88	1.55%	-
中金公司	2	266,942,826.22	1.11%	236,218.12	1.10%	-
海通证券	1	248,373,899.88	1.03%	226,119.38	1.06%	-
中银国际	1	13,746,926.30	0.06%	12,515.16	0.06%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

申银万国	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-

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
东方证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-

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 39 个交易单元与汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、中证医药卫生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、汇添富中证主要消费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、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、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共用。本报告期无新增和退租交易单元。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与哈尔滨银行开展的网上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 1 月 5 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2014 年年度资产净值的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 1 月 5 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加浦发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 1 月 8 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加重庆农商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 1 月 9 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于设立上海虹桥机场分公司的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 1 月 10 日
6	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 (新华保险)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 1 月 20 日
7	汇添富移动互联股票型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 1 月 22 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加浦发银行开展的定投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 2 月 6 日
9	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 (长亮科技)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 2 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调整停牌股票估值方法的公告（东方财富）	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 2 月 12 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海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 2 月 14 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加宜投基金为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 2 日
13	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（万达信息、信邦制药、天龙集团）	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 3 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在工商银行开通转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 5 日
15	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
16	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
17	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
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 3 月 10 日

	于旗下部分基金增加北京银行为销售机构的公告	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旗下部分基金增加钱景财富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 11 日
20	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
21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加江南农商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 3 月 12 日
22	关于汇添富移动互联股票型证券投资基金暂停大额申购(含定投及转换入)业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 13 日
23	关于汇添富移动互联股票型证券投资基金暂停大额申购(含定投及转换入)业务的提示公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 14 日
24	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(东方网力)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 18 日
25	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加晋商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 3 月 20 日
26	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(润和软件、中金财)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 21 日

27	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
28	关于汇添富移动互联股票型证券投资基金继续暂停大额申购(含定投及转换入)业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 27 日
29	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
30	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
31	汇添富移动互联股票型证券投资基金 2014 年年度报告	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
32	汇添富移动互联股票型证券投资基金 2014 年年度报告摘要	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
33	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
34	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
35	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(银之杰)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 8 日

36	汇添富移动互联股票型证券投资基金更新招募说明书（2015 年第 1 号）	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 10 日
37	汇添富移动互联股票型证券投资基金更新招募说明书摘要（2015 年第 1 号）	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 10 日
38	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（总经理、法人变更）	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
39	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
40	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
41	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
42	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
43	汇添富移动互联股票型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 21 日
44	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加瑞丰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 4 月 25 日

45	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加南商中国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 8 日
46	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旗下部分基金费率优惠的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 5 月 13 日
47	添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华夏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 14 日
48	关于汇添富移动互联股票型证券投资基金增加平安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 5 月 16 日
49	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
50	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 (广陆数测)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 5 月 22 日
51	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
52	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
53	汇添富基金管理股份有限公司关	中国证券报, 上海证	2015 年 6 月 26 日

	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	券报, 证券时报, 管理人网站	
54	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
55	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
56	关于汇添富移动互联股票型证券投资基金恢复大额申购(含定投及转换入)业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 6 月 30 日
57	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哈尔滨银行开展的网上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 30 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移动互联股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富移动互联股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富移动互联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、报告期内汇添富移动互联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