

# 汇添富恒生指数分级证券投资基金 2016 年 半年度报告

2016-06-30

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016-08-27

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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 2016 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>7</b>
2.1 基金基本情况.....	7
2.2 基金产品说明.....	8
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	9
2.5 信息披露方式.....	9
2.6 其他相关资料.....	9
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 .....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
4.9 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 .....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
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 .....	12
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 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表 .....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注 .....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	50
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	50
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	50

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	51
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	51
7.7 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 .....	52
7.8 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 .....	52
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金融衍生品投资明细 .....	52
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	53
7.11 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富恒生指数分级证券投资基金		
基金简称	汇添富恒生指数分级（QDII）		
场内简称	添富恒生		
基金主代码	164705		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014-03-06		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,949,690,094.30 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2014-04-11		
下属分级基金的基金简称	恒生 A	恒生 B	添富恒生
下属分级基金的场内简称	添富恒生 A	添富恒生 B	添富恒生
下属分级基金的交易代码	150169	150170	164705
报告期末下属分级基金的份 额总额	774,686,037.00	774,686,037.00	400,318,020.30

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数及标的指数所表征的股票市场相似的风险收益特征，在股票基金中属于中等风险、中等收益的产品。本基金为境外证券投资基金，主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场

	<p>投资所面临的特别投资风险。此外，从投资者具体持有的基金份额来看，在分级运作期内，由于基金收益分配的安排，稳健收益类的恒生 A 份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额；积极收益类的恒生 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。</p>
--	--

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	林葛
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座
邮政编码		200120	100031
法定代表人		李文	周慕冰

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

### 2.5 信息披露方式

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

### 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公 司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年01月01日-2016年06月30日)
本期已实现收益	-55,558,597.28
本期利润	-1,109,932.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0007
本期加权平均净值利润率	-0.08%
本期基金份额净值增长率	-1.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年06月30日)
期末可供分配利润	-107,051,720.84
期末可供分配基金份额利润	-0.0549
期末基金资产净值	1,789,473,168.46
期末基金份额净值	0.918
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-3.04%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.77%	1.38%	0.79%	1.34%	0.98%	0.04%
过去三个月	3.73%	1.18%	2.55%	1.17%	1.18%	0.01%
过去六个月	-1.68%	1.37%	-2.98%	1.31%	1.30%	0.06%
过去一年	-11.34%	1.47%	-13.36%	1.43%	2.02%	0.04%
自基金合同生效日起至今	-3.04%	1.14%	-0.02%	1.15%	-3.02%	-0.01%

注：本基金的《基金合同》生效日为2014年3月6日，至本报告期末未满三年。

### 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

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的《基金合同》生效日为 2014 年 3 月 6 日，本基金建仓期为自《基金合同》生效之日（2014 年 3 月 6 日）起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。截至本报告期末，基金成立未满三年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立，注册资本为 11762.2978 万元人民币。截止到 2016 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 2857 亿元，有效客户数约 1200 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 63 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、汇添富均衡增长混合型证券投资基金、汇添富成长焦点混合型证券投资基金、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、汇添富价值精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富民营活力混合型证券投资基金、汇添富香港优势混合型证券投资基金、汇添富医疗保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、汇添富可转换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 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、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、汇添富优选回报混合型证券投资基金、汇添富消费行业混合型证券投资基金、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 混合型证券投资基金、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、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、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、汇添富国企创新增长股票型证券投资基金、汇添富民营新动力股票型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富新兴消费股票型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金、汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富盈安保本混合型证券投资基金、汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金。

#### 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		
赖中立	汇添富黄金及贵金属基金（LOF）的基金经理、汇添富恒生指数分级	2014-03-06		9 年	国籍：中国，学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士，相关业务

	<p>(QDII) 基金、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富香港优势精选混合基金的基金经理。</p>				<p>资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属基金(LOF)的基金经理，2014年3月6日至今任汇添富恒生指数分级(QDII)基金的基金经理，2015年1月6日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基</p>
--	--	--	--	--	---

					金的基金 经 理 ， 2015 年 5 月 26 日至 今任汇添 富香港优 势混合基 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 16 年上半年，香港市场在年初回调后进入宽幅振荡区间，投资者情绪相对较为稳定。相比 2016 年年初市场的快速下跌，二季度香港市场投资环境转为温和，香港市场整体估值已经非常便宜，在此环境下，市场参与者逐渐开始寻找做多布局的机会。6 月份英国脱欧事件对之前的市场存在预期上的压制作用，但当靴子落地之后，市场也做出了较为乐观的反应。整体来看，在经历了之前的系统性风险之后，香港市场在盘整中逐渐找到底部位置，随着全球资本市场趋于均衡，投资者情绪逐渐稳定，香港市场蕴含的投资机会将逐渐显现。报告期内，本基金按照基金合同，按照完全复制法进行恒生指数成份股指数化投资，严控基金跟踪误差，以为投资者带来与恒生指数一致的收益。

##### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金净值上涨-1.68%，业绩比较基准上涨-2.98%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 16 年下半年，香港市场逐渐筑底的过程仍在进行，有望在全球经济金融形势转为乐观之后贡献可观收益。市场底部的构建主要来自两方面的力量：估值水平和市场情绪。从估值水平来看，当前恒生指数整体市盈率等财务指标已经处于历史相对低位。而在以机构主导的香港市场，当估值趋于合理时市场会给予理性的反馈。我们认为，若市场继续非理性下行，则股票市场的价值发现作用将很快得以凸显，香港市场价格低廉的优质股票将非常具有吸引力。近期香港市场的表现已经显露出了估值修复的态势，有望引导市场参与者的做多情绪。从市场情绪来看，香港市场是一个充分国际化的市场，充分受益全球风险偏好的提升。我们认为在这个估值区间进行分批配置，耐心等待新的上涨周期，将是比较稳健的投资策略。

#### 4.7 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。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、基金营运部和稽核监察部人员组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有丰富的证券基金行业从业经验，能够胜任估值决策工作，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理不介入基金日常估值业务，但可以参加估值小组会议，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。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

#### 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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露

露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 06 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	374,533,755.62	191,066,769.32
结算备付金		153,231,126.27	107,805,656.06
存出保证金		43,672,808.30	18,630,132.75
交易性金融资产	6.4.7.2	1,210,407,112.59	1,191,249,116.44
其中：股票投资		1,210,407,112.59	1,191,249,116.44
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证 券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	56,740.63	6,594.61
应收股利		13,608,206.27	57,673.04
应收申购款		109,742.95	2,629,686.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,795,619,492.63	1,511,445,628.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 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		129.17	134.67

应付赎回款		3,456,996.14	215,144.14
应付管理人报酬		1,435,998.34	1,506,803.28
应付托管费		299,166.31	313,917.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	357,282.97	-
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	596,751.24	498,510.24
负债合计		6,146,324.17	2,534,509.67
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,896,524,889.30	1,563,251,291.04
未分配利润	6.4.7.10	-107,051,720.84	-54,340,172.08
所有者权益合计		1,789,473,168.46	1,508,911,118.96
负债和所有者权益总计		1,795,619,492.63	1,511,445,628.63

注：(1) 报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.918 元，基金份额总额 1,949,690,094.30 份，其中下属添富恒生份额净值 0.918 元，份额总额 400,318,020.30 份；下属恒生 A 份额净值 1.022 元，份额总额 774,686,037.00 份；下属恒生 B 份额净值 0.814 元，份额总额 774,686,037.00 份。(2) 报表附注为财务报表的组成部分。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 06 月 30 日	2015 年 01 月 01 日 至 2015 年 06 月 30 日
<b>一、收入</b>		11,409,159.56	-254,650,423.95
1. 利息收入		545,880.80	5,642,287.44
其中：存款利息收入	6.4.7.11	545,880.80	5,642,287.44
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利		-	-

息收入			
2. 投资收益 (损失以“-” 填列)		-51,434,945.95	9,551,283.62
其中: 股票投 资收益	6.4.7.12	-72,437,221.11	33,465,131.75
基金投 资收益	6.4.7.13	-	-
债券投 资收益	6.4.7.14	-	-
资产支 持证券投资收 益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属 投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工 具收益	6.4.7.16	-4,259,621.71	-66,677,446.85
股利收 益	6.4.7.17	25,261,896.87	42,763,598.72
3. 公允价值变 动收益(损失 以“-”号填列)	6.4.7.18	54,448,664.48	-249,215,318.14
4. 汇兑收益 (损失以“-” 号填列)		7,089,018.98	-23,074,213.91
5. 其他收入 (损失以“-” 号填列)	6.4.7.19	760,541.25	2,445,537.04
<b>减: 二、费用</b>		12,519,092.36	32,407,835.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,411,217.39	18,410,912.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,752,336.88	3,835,606.78
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	1,848,970.20	9,150,191.04
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回 购金融资产支 出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	506,567.89	1,011,125.75
<b>三、利润总额 (亏损总额以 “-”号填列)</b>		-1,109,932.80	-287,058,259.89

注: 后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。



### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 06 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）	1,563,251,291.04	-54,340,172.08	1,508,911,118.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-1,109,932.80	-1,109,932.80
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）	333,273,598.26	-51,601,615.96	281,671,982.30
其中：1. 基金申购款	6,687,533,075.91	728,503,567.49	7,416,036,643.40
2. 基金赎回款	-6,354,259,477.65	-780,105,183.45	-7,134,364,661.10
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）	1,896,524,889.30	-107,051,720.84	1,789,473,168.46
项目	上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日 至 2015 年 06 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）	163,086,548.73	10,101,509.69	173,188,058.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-287,058,259.89	-287,058,259.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	5,928,023,495.27	697,634,313.64	6,625,657,808.91

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	69,312,002,155.27	887,244,296.20	70,199,246,451.47
2. 基金赎回款	-63,383,978,660.00	-189,609,982.56	-63,573,588,642.56
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)	6,091,110,044.00	420,677,563.44	6,511,787,607.44

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖	张晖	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

汇添富恒生指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]1247号文《关于核准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2014年3月6日正式生效，首次设立募集规模为1,270,631,138.98份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司，境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司(The Hong Kong and Shanghai Banking Co., Ltd.)。本基金的份额包括汇添富恒生指数分级证券投资基金之基础份额（简称“添富恒生份额”）、汇添富恒生指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“恒生A份额”）与汇添富恒生指数分级证券投资基金之积极收益类份额（简称“恒生B份额”）。其中，恒生A、恒生B的基金份额配比始终保持1:1的比率不变。本基金的基础份额为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。恒生A份额将具有低风险、收益稳定特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额，类似于债券型基金份额。恒生B份额则具有高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额，类似于具有收益杠杆性的股票型基金份额。本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于债券、基金（包括股票基金、债

券基金、交易所交易基金等)、金融衍生工具(包括远期合约、互换、期货、期权、权证等)、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的 80%。本基金的业绩比较基准:经人民币汇率调整的恒生指数收益率 $\times 95\%$ +商业银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 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

经国务院批准,自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:(1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税或增值税征收范围,不征收营业税或增值税;(2) 基金

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日
活期存款	374,533,755.62
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	374,533,755.62

注：本基金于 2016 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 157,483,186.29 元（折合人民币 134,596,154.83 元），美元 51.22 元（折合人民币 339.65 元）。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,338,648,758.25	1,210,407,112.59	-128,241,645.66
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,338,648,758.25	1,210,407,112.59	-128,241,645.66

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-
其他衍生工具	465,472,084.74	19,331,738.00	-
合计	465,472,084.74	19,331,738.00	-

注：（1）衍生金融资产项下的股指期货投资净额折合人民币 0.00 元。在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益折合人民币 19,331,738.00 元）之间按抵销后的净额折合人民币 0.00 元；（2）本基金本期末持有恒生指数期货合约(Hang Seng Index Futures) 520 张；

#### 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 2016 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	48,081.42
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	8,659.21
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借利息	-
其他	-
合计	56,740.63

注：应收结算备付金利息为应收港股通备付金利息。

#### 6.4.7.6 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 2016 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	357,282.97

银行间市场应付交易费用	-
合计	357,282.97

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12,500.97
应付审计费用	24,863.02
应付信息披露费用	249,178.12
应付指数费用	280,373.87
应付上市费用	29,835.26
合计	596,751.24

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,567,164,608.27	1,563,251,291.04
本期申购	6,687,533,075.91	6,687,533,075.91
本期赎回（以“-”号填列）	-6,354,259,477.65	-6,354,259,477.65
-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	49,251,887.77	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,949,690,094.30	1,896,524,889.30

#### 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	-154,201,935.79	99,861,763.71	-54,340,172.08
本期利润	-55,558,597.28	54,448,664.48	-1,109,932.80
本期基金份额交易产生的变动数	214,315,323.77	-265,916,939.73	-51,601,615.96
其中：基金申购款	1,337,277,114.52	-608,773,547.03	728,503,567.49
基金赎回款	-1,122,961,790.75	342,856,607.30	-780,105,183.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,554,790.70	-111,606,511.54	-107,051,720.84

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 01 月 01 日	至 2016 年 06 月 30 日
活期存款利息收入		518,025.36
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		23,665.75
其他		4,189.69
合计		545,880.80

注：“其他”为直销申购款利息收入。

### 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	
	2016 年 01 月 01 日	至 2016 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额		364,209,194.62
减：卖出股票成本总额		436,646,415.73
买卖股票差价收入		-72,437,221.11

#### 6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	
	2016 年 01 月 01 日	至 2016 年 06 月 30 日
股指期货投资收益		-4,259,621.71

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 01 月 01 日	至 2016 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益		25,261,896.87

基金投资产生的股利收益	-
合计	25,261,896.87

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年01月01日至2016年06月30日
1. 交易性金融资产	35,135,273.86
——股票投资	35,135,273.86
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	19,313,390.62
合计	54,448,664.48

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年01月01日至2016年06月30日
基金赎回费收入	760,541.25
其他	-
合计	760,541.25

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年01月01日至2016年06月30日
交易所市场交易费用	1,848,970.20
银行间市场交易费用	-
合计	1,848,970.20

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年01月01日至2016年06月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	149,178.12
证券组合费	15,549.50
汇款费	6,678.12
上市费	29,835.26
托管账户维护费	90.00



指数使用费	280,373.87
合计	506,567.89

#### 6.4.7.22 分部报告

收入	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日至2016年06月30日	2015年01月01日至2015年06月30日
中国大陆	1,306,422.05	8,087,823.75
中国香港	3,013,718.53	-262,738,247.68
其他	7,089,018.98	6,692,969.93
合计	11,409,159.56	-254,650,423.93

注：截止 2016 年 6 月 30 日至，本基金无非流动资产。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控有限责任公司	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
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	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的关键管理人员
香港上海汇丰银行有限公司	基金境外托管人

注：1、经本公司 2016 年第二次股东大会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准，本公司的股东文汇新民联合报业集团已变更为上海上报资产管理有限公司。本公司已于 2016 年 8 月 13 日就上述股东变更事项进行公告。2、以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年06月30日		上年度可比期间 2015年01月01日至2015年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东方证券股份有限公司	421,101,775.15	53.68%	1,760,792,477.71	46.69%

##### 6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	421,100.80	45.47%	357,282.97	100.00%

  

关联方名称	上年度可比期间 2015年01月01日至2015年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	1,760,790.75	100.00%	1,760,790.75	100.00%

##### 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 2016年01月01日至2016年06月30日	上年度可比期间 2015年01月01日至2015年06月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	8,411,217.39
其中：支付销售机构的客户维护费	215,597.3	329,191.02

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 06 月 30 日	2015 年 01 月 01 日 至 2015 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,752,336.88	3,835,606.78

#### 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

#### 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内及上年度可比区间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

恒生 A				
关联方名称	本期末 2016 年 06 月 30 日		上年度末 2015 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
-		%		%
恒生 B				
关联方名称	本期末 2016 年 06 月 30 日		上年度末 2015 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	2,088,991.00	0.27%	0.00	0.00%

##### 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 2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日 至 2015 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	239,937,397.99	541,691.11	3,531,993,988.44	5,642,287.44
汇丰银行	134,596,357.63	-	-	-

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

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期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：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末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

##### 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
01583 HG	亲亲食品	2016-06-29	未上市	11.00	2016-07-08	9.19	17,300.00	163,155.61	190,300.00	
1583 K	HQINQIN FOODSTUFFS GROUP	2016-06-29	未上市	11.00	2016-07-08	9.19	14,100.00	132,976.54	155,100.00	

注：本报告期末上述暂时停牌流通受限股票的“期末估值总额”计价币种为港币。

##### 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：本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

###### 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质押的债券。

#### 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同责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。此外,基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%,其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。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,基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持证券均在证券交易所上市;因此,本基金除 6.4.12 列示期末本基金持有的流通受限证券之外,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 2016 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存	374,533,755.62	-	-	-	-	-	374,533,755.62

款							
备付金	153,231,126.27	-	-	-	-	-	153,231,126.27
存出保 证金	43,672,808.30	-	-	-	-	-	43,672,808.30
交易性 金融资 产	-	-	-	-	-	1,210,407,112.59	1,210,407,112.59
应收股 利	-	-	-	-	-	13,608,206.27	13,608,206.27
应收利 息	-	-	-	-	-	56,740.63	56,740.63
应收申 购款	22,523.31	-	-	-	-	87,219.64	109,742.95
衍生金 融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证 券清算 款	-	-	-	-	-	-	-
其他资 产	-	-	-	-	-	-	-
资产总 计	571,460,213.5	-	-	-	-	1,224,159,279.13	1,795,619,492.63
负债							
应付赎 回款	-	-	-	-	-	3,456,996.14	3,456,996.14
应付管 理人报 酬	-	-	-	-	-	1,435,998.34	1,435,998.34
应付托 管费	-	-	-	-	-	299,166.31	299,166.31
应付交 易费用	-	-	-	-	-	357,282.97	357,282.97
应付证 券清算 款	-	-	-	-	-	129.17	129.17
衍生金 融负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负 债	-	-	-	-	-	596,751.24	596,751.24
负债总 计	-	-	-	-	-	6,146,324.17	6,146,324.17
利率敏 感度缺 口	571,460,213.5	-	-	-	-	1,218,012,954.96	1,789,473,168.46

上年度末 2015 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	191,066,769.32	-	-	-	-	-	191,066,769.32
备付金	107,805,656.06	-	-	-	-	-	107,805,656.06
存出保证金	18,630,132.75	-	-	-	-	-	18,630,132.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,191,249,116.44	1,191,249,116.44
应收股利	-	-	-	-	-	57,673.04	57,673.04
应收利息	-	-	-	-	-	6,594.61	6,594.61
应收申购款	14,374.07	-	-	-	-	2,615,312.34	2,629,686.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	317,516,932.20	-	-	-	-	1,193,928,696.43	1,511,445,628.63
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	215,144.14	215,144.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,506,803.28	1,506,803.28
应付托管费	-	-	-	-	-	313,917.34	313,917.34
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	134.67	134.67
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-	-	498,510.24	498,510.24
负债总计	-	-	-	-	-	2,534,509.67	2,534,509.67
利率敏感度缺口	317,516,932.20	-	-	-	-	-1,191,394,186.76	1,508,911,118.96

注：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、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

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	339.65	134,596,154.83	-	134,596,494.48
存出保证金	-	27,599,003.64	-	27,599,003.64
交易性金融资产	-	1,210,407,112.59	-	1,210,407,112.59
应收股利	-	7,076,790.44	-	7,076,790.44
应收利息	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-



其它资产	-	153,231,126.27	-	153,231,126.27
资产合计	339.65	1,532,910,187.77	-	1,532,910,527.42
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债 表外汇风 险敞口净 额	339.65	1,532,910,187.77	-	1,532,910,527.42
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	332.60	163,269,364.08	-	163,269,696.68
存出保证金	-	107,805,656.06	-	107,805,656.06
交易性金融资产	-	1,191,249,116.44	-	1,191,249,116.44
应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	18,630,132.75	-	18,630,132.75
资产合计	332.60	1,480,954,269.33	-	1,480,954,601.93
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债 表外汇风 险敞口净 额	332.60	1,480,954,269.33	-	1,480,954,601.93

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑管理人人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年06月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	港币相对人民币升值 5%	69,915,708.49	74,047,730.10
	港币相对人民币贬值 5%	-69,915,708.49	-74,047,730.10
	美元相对人民币升值 5%	16.98	16.63
	美元相对人民币贬值 5%	-16.98	-16.63

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

注：本基金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。本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。另外还可投资于债券、基金、金融衍生工具、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，所面临的最大的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 2016年06月30日		上年度末 2015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	1,210,407,112.59	67.64	1,191,249,116.44	78.95
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	1,210,407,112.59	67.64	1,191,249,116.44	78.95

注：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的 80%。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

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合的贝塔系数紧密相关；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（2016年06月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	经人民币汇率调整的恒生指数收益率增加 5%	89,677,432.74	7,1081,790.74
	经人民币汇率调整的恒生指数收益率减少 5%	-89,677,432.74	-71,081,790.74

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,210,407,112.59	67.41
	其中：普通股	1,210,407,112.59	67.41
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

	产		
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	527,764,881.89	29.39
8	其他各项资产	57,447,498.15	3.20
9	合计	1,795,619,492.63	100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 668,095,903.80 人民币，占期末净值比例 37.33%。

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
香港	1,210,407,112.59	67.64
合计	1,210,407,112.59	67.64

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
10 能源	89,587,398.27	5.01
20 工业	70,819,518.88	3.96
25 非必需消费品	30,638,158.88	1.71
30 必需消费品	25,776,436.97	1.44
40 金融	680,840,865.94	38.05
45 信息技术	129,168,610.35	7.22
50 电信服务	107,174,182.15	5.99
55 公用事业	76,401,941.15	4.27
合计	1,210,407,112.59	67.64

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	香港	817,700.00	123,069,890.35	6.88
2	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股	5 HK	香港联	香港	2,767,600.00	112,000,965.17	6.26

				合交易所				
3	AIA GROUP LTD	友邦 保险	1299 HK	香港 联合 交易所	香港	2,549,400.00	100,991,815.60	5.64
4	CHINA MOBILE LTD	中国 移动	941 HK	香港 联合 交易所	香港	1,300,000.00	98,496,444.15	5.50
5	CHINA CONSTRUCTION B	建设 银行	939 HK	香港 联合 交易所	香港	17,805,000.00	77,913,084.67	4.35
6	IND & COMM BK OF CHI	工商 银行	1398 HK	香港 联合 交易所	香港	15,611,000.00	57,238,266.96	3.20
7	BANK OF CHINA LTD-H	中国 银行	3988 HK	香港 联合 交易所	香港	16,810,000.00	44,394,038.34	2.48
8	CHEUNG KONG HOLDINGS	长和	1 HK	香港 联合 交易	香港	571,848.00	41,323,079.47	2.31

				所				
9	HONG KONG EXCHANGES	香港交易所	388 HK	香港联合交易所	香港	242,900.00	38,945,636.75	2.18
10	PING AN INSURANCE GR	中国平安	2318 HK	香港联合交易所	香港	1,103,000.00	32,193,239.49	1.80
11	CNOOC LTD	中国海洋石油	883 HK	香港联合交易所	香港	3,779,000.00	31,070,656.09	1.74
12	CLP HOLDINGS LTD	中电控股	2 HK	香港联合交易所	香港	401,000.00	27,075,090.94	1.51
13	CHINA PETROLEUM & CH	中国石油化工股份	386 HK	香港联合交易所	香港	5,398,000.00	25,835,648.50	1.44
14	SUN HUNG KAI PROPERT	新鸿基地产	16 HK	香港联合交易所	香港	306,000.00	24,335,275.31	1.36
15	CHEUNG KONG PROPERTY	长实地产	1113 HK	香港	香港	571,848.00	23,655,080.38	1.32

	HOLDING			联合交易所				
16	CHINA LIFE INSURANCE	中国人寿	2628 HK	香港联合交易所	香港	1,575,000.00	22,372,269.25	1.25
17	LINK REIT	领汇房产基金	823 HK	香港联合交易所	香港	475,000.00	21,435,123.60	1.20
18	PETROCHINA CO LTD-H	中国石油股份	857 HK	香港联合交易所	香港	4,464,000.00	20,182,656.00	1.13
19	HONG KONG & CHINA GA	香港中华煤气	3 HK	香港联合交易所	香港	1,614,566.00	19,512,084.69	1.09
20	HANG SENG BANK LTD	恒生银行	11 HK	香港联合交易所	香港	161,800.00	18,295,185.68	1.02
21	POWER ASSETS HOLDING	电能实业	6 HK	香港联合交	香港	293,500.00	17,822,583.07	1.00

				易所				
22	CHINA OVERSEAS LAND	中国海外发展	688 HK	香港联合交易所	香港	834,000.00	17,463,472.11	0.98
23	BOC HONG KONG HOLDIN	中银香港	2388 HK	香港联合交易所	香港	783,000.00	15,525,593.36	0.87
24	CITIC Pacific Limited	中信股份	267 HK	香港联合交易所	香港	1,231,000.00	11,867,674.12	0.66
25	WHARF HOLDINGS LTD	九龙仓集团	4 HK	香港联合交易所	香港	289,000.00	11,596,632.63	0.65
26	SANDS CHINA LTD	金沙中国有限公司	1928 HK	香港联合交易所	香港	512,400.00	11,364,358.96	0.64
27	MTR CORP	港铁公司	66 HK	香港联合交易所	香港	310,000.00	10,385,949.84	0.58
28	GALAXY	银河	27 HK	香	香港	496,000.00	9,750,075.36	0.54



	ENTERTAINMENT	娱乐		港 联 合 交 易 所				
29	HENGAN INTL GROUP CO	恒安 国际	1044 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	167,000.00	9,234,623.88	0.52
30	CHINA RESOURCES LAND	华 润 置 地	1109 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	586,444.00	9,072,011.29	0.51
31	CHINA SHENHUA ENERGY	中 国 神 华	1088 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	719,000.00	8,762,880.23	0.49
32	CHINA UNICOM HONG KO	中 国 联 通	762 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	1,266,000.00	8,677,738.00	0.48
33	HENDERSON LAND DEVEL	恒 基 地 产	12 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	231,375.00	8,611,980.77	0.48
34	SWIRE PACIFIC LTD-A	太 古 股 份 公 司 A	19 HK	香 港 联 合	香 港	115,000.00	8,609,945.58	0.48

				交易所				
35	CHEUNG KONG INFRASTR	长江 基建 集团	1038 HK	香港 联合 交易所	香港	140,000.00	7,980,908.46	0.45
36	NEW WORLD DEVELOPMEN	新世 界发 展	17 HK	香港 联合 交易所	香港	1,177,000.00	7,896,680.73	0.44
37	The Bank of East Asia Limited	东亚 银行	23 HK	香港 联合 交易所	香港	307,400.00	7,829,221.63	0.44
38	BANK OF COMMUNICATIO	交通 银行	3328 HK	香港 联合 交易所	香港	1,852,000.00	7,740,130.82	0.43
39	Sino Land Company Limited	信和 置业	83 HK	香港 联合 交易所	香港	648,000.00	7,011,439.19	0.39
40	WANT WANT CHINA HOLD	中国 旺旺	151 HK	香港 联合 交易所	香港	1,482,000.00	6,966,415.18	0.39

41	CHINA MENGNIU DAIRY	蒙牛乳业	2319 HK	香港 联合交易所	香港	581,000.00	6,693,672.88	0.37
42	LENOVO GROUP LTD	联想集团	992 HK	香港 联合交易所	香港	1,528,000.00	6,098,720.00	0.34
43	HANG LUNG PROPERTIES	恒隆地产	101 HK	香港 联合交易所	香港	428,000.00	5,713,776.63	0.32
44	BELLE INTERNATIONAL	百丽国际	1880 HK	香港 联合交易所	香港	1,428,000.00	5,540,928.17	0.31
45	CHINA MERCHANTS HLDG	招商局国际	144 HK	香港 联合交易所	香港	274,000.00	4,824,099.35	0.27
46	CHINA RESOURCES POWER	华润电力	836 HK	香港 联合交易所	香港	406,000.00	4,011,273.99	0.22
47	Li and Fung Limited	利丰	494 HK	香港 联	香港	1,246,000.00	3,982,796.39	0.22

				合交易所				
48	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆仑能源	135 HK	香港联合交易所	香港	684,000.00	3,735,557.45	0.21
49	TINGYI (CAYMAN ISLN)	康师傅控股	322 HK	香港联合交易所	香港	414,000.00	2,586,522.01	0.14
50	CATHAY PACIFIC AIRWA	国泰航空	293 HK	香港联合交易所	香港	250,000.00	2,418,716.10	0.14
51	QINQIN FOODSTUFFS GROUP	亲亲食品	1583 HK	香港联合交易所	香港	31,400.00	295,203.02	0.02

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	HSBC HOLDINGS PLC	5 HK	38,385,028.19	2.54
2	CHINA MOBILE LTD	941 HK	34,358,051.14	2.28
3	AIA GROUP LTD	1299 HK	33,870,762.79	2.24
4	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	31,761,785.74	2.10
5	CHINA CONSTRUCTION B	939 HK	26,634,227.38	1.77

6	IND & COMM BK OF CHI	1398 HK	20,068,577.27	1.33
7	CHEUNG KONG HOLDINGS	1 HK	15,883,997.06	1.05
8	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	15,662,221.70	1.04
9	HONG KONG EXCHANGES	388 HK	14,581,671.96	0.97
10	PING AN INSURANCE GR	2318 HK	11,571,669.05	0.77
11	CNOOC LTD	883 HK	10,378,904.50	0.69
12	CHINA PETROLEUM & CH	386 HK	9,299,414.92	0.62
13	CLP HOLDINGS LTD	2 HK	8,957,465.59	0.59
14	CHEUNG KONG INFRASTR	1038 HK	8,947,710.11	0.59
15	CITIC Pacific Limited	267 HK	8,556,630.29	0.57
16	CHINA LIFE INSURANCE	2628 HK	8,230,159.03	0.55
17	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	1113 HK	8,028,862.39	0.53
18	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	7,122,015.49	0.47
19	LINK REIT	823 HK	6,746,740.11	0.45
20	HANG SENG BANK LTD	11 HK	6,576,763.07	0.44

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	66,981,395.23	4.44
2	HSBC HOLDINGS PLC	5 HK	24,508,317.25	1.62
3	AIA GROUP LTD	1299 HK	21,795,347.60	1.44
4	CHINA MOBILE LTD	941 HK	20,714,237.48	1.37
5	CHEUNG KONG HOLDINGS	1 HK	13,354,563.38	0.89
6	CHINA CONSTRUCTION B	939 HK	12,920,972.64	0.86
7	IND & COMM BK OF CHI	1398 HK	9,258,792.17	0.61
8	HONG KONG EXCHANGES	388 HK	8,858,772.42	0.59
9	CLP HOLDINGS LTD	2 HK	7,248,096.28	0.48
10	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	6,771,693.44	0.45
11	PING AN INSURANCE GR	2318 HK	6,515,129.12	0.43
12	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	1113 HK	5,775,145.15	0.38

13	CITIC Pacific Limited	267 HK	5,612,077.00	0.37
14	CNOOC LTD	883 HK	5,539,279.94	0.37
15	POWER ASSETS HOLDING	6 HK	5,393,097.24	0.36
16	LINK REIT	823 HK	5,178,543.33	0.34
17	HANG SENG BANK LTD	11 HK	5,043,473.07	0.33
18	SUN HUNG KAI PROPERT	16 HK	4,793,551.65	0.32
19	CHINA OVERSEAS LAND	688 HK	4,596,855.44	0.30
20	CHINA PETROLEUM & CH	386 HK	4,429,355.63	0.29

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	420,373,005.92
卖出收入（成交）总额	436,646,415.73

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 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。

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

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	期货品种_股指	HSI1607	465,472,084.74	26.01

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

注：本基金本报告期末未持有基金。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

#### 7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	43,672,808.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	13,608,206.27
4	应收利息	56,740.63
5	应收申购款	109,742.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	57,447,498.15

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
恒生A	962	805,286.94	656,886,740.00	84.79	117,799,297.00	15.21
恒生B	13,290	58,290.90	259,808,341.00	33.54	514,877,696.00	66.46
添富恒生	4,964	80,644.24	254,944,274.07	63.69	145,373,746.23	36.31
合计	19,216	101,461.81	1,171,639,355.07	60.09	778,050,739.23	39.91

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

恒生 A			
序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司一分红-个人分红	54,704,048.00	7.06
2	中国银河证券股份有限公司	52,000,000.00	6.17

3	银华财富资本—工商银行—银华财富资本管理（北京）有限公司	48,515,200.00	6.26
4	工银瑞信基金—农业银行—中油财务有限责任公司	43,132,074.00	5.57
5	银华财富资本—工商银行—银华财富资本管理（北京）有限公司	41,043,918.00	5.30
6	广东君之健投资管理有限公司—君之健翱翔稳进证券投资基金	38,696,000.00	5.00
7	银华财富资本—工商银行—银华财富资本管理（北京）有限公司	28,521,948.00	3.68
8	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	25,998,866.00	3.36
9	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅一号证券投资基金（私募）	22,413,324.00	2.89
10	嘉实资本—中国银行—粤享财富3号—嘉实资本分级基金A份额	19,370,820.00	2.50
恒生 B			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中信证券股份有限公司	75,911,696.00	9.80
2	中国对外经济贸易信托有限公司—昀沅证券投资集合资金信托计划	60,722,287.00	7.84
3	北京千石创富—光大银行—千石资本—千纸鹤1号资产管理计划	37,500,000.00	4.84
4	中铁宝盈资产—招商银行—外贸信托—昀沅3号证券投资集合资	31,780,400.00	4.10
5	瑞泰人寿保险有限公司—万能	9,225,100.00	1.19
6	鹏华基金—工商银行—前海人寿保险股份有限公司	8,802,095.00	1.14
7	上海明法投资管理有	6,075,468.00	0.78



	限公司—明泓多策略 对冲 1 号基金		
8	钟少稳	5,617,977.00	0.73
9	杨继耘	5,501,000.00	0.71
10	李莉	5,493,184.00	0.71
添富恒生			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	华宝信托有限责任公 司—单一类资金信托 R2009ZX002	9,298,722.00	10.97
2	李莉	7,686,371.00	9.07
3	钟少稳	6,397,307.00	7.55
4	银河资本—光大银行 —银河资本青昀套利 10 号资产管理计划	3,387,133.00	4.00
5	王建新	2,978,192.00	3.51
6	中信信托有限责任公 司—上善若水 3 期成长 策略精选管理型证券	2,405,701.00	2.84
7	五矿经易期货有限公 司—五矿经易期货工 银量化恒盛精选 D 类 43	2,337,078.00	2.76
8	郑岳龙	2,278,338.00	2.69
9	张颇	1,920,814.00	2.27
10	李仕贵	1,829,093.00	2.16

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	恒生 A	0	0
	恒生 B	0	0
	添富恒生	51,535.60	0.01
	合计	51,535.60	0.00

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 （万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	恒生 A	0
	恒生 B	0
	添富恒生	0

	合计	0
本基金基金经理持有本 开放式基金	恒生 A	0
	恒生 B	0
	添富恒生	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	恒生 A	恒生 B	添富恒生
基金合同生效日 (2014-03-06)基金 份额总额	109,711,438.00	109,711,438.00	1,051,208,262.98
本报告期期初基金 份额总额	718,983,211.00	718,983,211.00	129,198,186.27
本报告期基金总申 购份额	-	-	1,038,936,853.91
减:本报告期基金总 赎回份额	-	-	705,663,255.65
本报告期基金拆分 变动份额(份额减少 以“-”填列)	55,702,826.00	55,702,826.00	-62,153,764.23
本报告期末基金 份额总额	774,686,037.00	774,686,037.00	400,318,020.30

注：总申购份额含红利再投份额。

## § 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 2016 年 1 月 14 日公告，陈晓翔先生不再担任汇添富价值精选混合型证券投资基金的基金经理，由劳杰男先生单独管理该基金。

2、《汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 1 月 21 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

3、《汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 11 日正式生效，何旻先

生和李怀定先生任该基金的基金经理。

4、基金管理人 2016 年 3 月 12 日公告，增聘马翔先生担任汇添富民营活力混合型证券投资基金的基金经理，同时，朱晓亮先生不再担任该基金的基金经理。

5、《汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 16 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2016 年 4 月 2 日公告，陈灿辉先生不再担任副总经理。

7、基金管理人 2016 年 4 月 9 日公告，增聘胡昕炜先生担任汇添富消费行业混合型证券投资基金的基金经理，同时，朱晓亮先生不再担任该基金的基金经理。

8、《汇添富盈安保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 19 日正式生效，曾刚先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。

9、《汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 3 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。

10、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

11、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

12、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

13、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富理财 30 天债券型证券投资基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

14、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富添富通货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

15、基金管理人 2016 年 6 月 8 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

16、本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，针对中国证监会出具的责令改正措施，以及对相关负责人的警示，公司高度重视，逐一落实各项整改要求，针对性的制定、实施整改措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理的能力。目前公司已完成相关整改工作。

#### 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		421,101,775.15	53.68%	421,100.8	45.47%	
海通证券		49,234,104.59	6.28%	49,234.48	5.32%	
瑞士信贷		103,291,127.51	13.17%	147,348.25	15.91%	
招商香港		11,109,308.72	1.42%	8,887.45	0.96%	
凯基证券		199,679,947.65	25.46%	299,519.94	32.34%	
-	-	-	-%	-	-%	

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

注: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。

### 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基金 2015 年年度资产净值的公告	管理人网站	2016-01-04
2	汇添富基金管理股份有限公司关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断后调整旗下部分基金申购与赎回开放时间的公告	管理人网站	2016-01-04
3	汇添富基金管理股份有限公司关于调整指数熔断机制下的基金申购与赎回开放时间的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 上交所, 深交所	2016-01-04
4	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金之恒生 A 份额本次定期折算期间约定年基准收益率的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2016-01-05
5	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间添富恒生份额、恒生 A 份额停复牌的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2016-01-05
6	汇添富基金管理股份有限公司关于指数熔断期间旗下场内基金申购赎回业务安排的提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2016-01-06
7	关于添富恒生份额、恒生 A 份额定期份额折算后复牌首日前收盘价调整的风险提示公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2016-01-06
8	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管	2016-01-06

	交易的公告	理人网站, 深交所	
9	汇添富基金管理股份有限公司关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断后调整旗下部分基金申购与赎回开放时间的公告	管理人网站	2016-01-07
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加众禄金融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	2016-01-20
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加恒天明泽为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016-01-27
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加农业银行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	2016-02-18
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加新兰德为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016-02-20
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加光大证券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	2016-02-20
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加开源证券为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016-02-24
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加宜信普泽为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016-02-27
17	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在大同证券开通定投业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016-03-04
18	汇添富基金管理股份有限公司关于人员在子公司兼职情况变更的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016-03-16
19	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2016-03-23
20	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	2016-03-28
21	汇添富基金管理股份有限公司关	中国证券报, 上海证	2016-03-31

	于旗下部分基金参加好买基金开展的申购基金费率优惠活动的公告	券报, 证券时报, 管理人网站	
22	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(副总经理)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016-04-02
23	汇添富恒生指数分级证券投资基金基金更新招募说明书摘要(2016年第1号)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016-04-20
24	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与诺亚正行开展的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	2016-05-12
25	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加首创证券为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016-05-12
26	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加云湾投资为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016-06-24

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的文件;
- 2、《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富恒生指数分级证券投资基金托管协议》;
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 5、报告期内汇添富恒生指数分级证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 11.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理股份有限公司

### 11.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅, 或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 查阅, 还可拨打基金管理人客户服务中心电话: 400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司  
2016-08-27