

# 汇添富国企创新增长股票型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 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：2016 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富国企创新增长股票型证券投资基金
基金简称	汇添富国企创新股票
基金主代码	001490
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 10 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	1,754,083,602.37 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，精选国企创新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	专注于挖掘契合经济升级创新方向，通过混合所有制改革、资产整合、员工持股激励等方式实现释放企业活力，提升企业经营效率的国有上市企业；同时，也密切关注随着国企改革的深入，影响范围的扩大，受益于行业准入、国退民进、创新合作等相关主题的其他上市企业的投资机会。
业绩比较基准	中证国有企业综合指数×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	洪渊
	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

## 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

## § 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 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-52,450,678.71
本期利润	-289,126,401.86
加权平均基金份额本期利润	-0.1584
本期基金份额净值增长率	-14.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0508
期末基金资产净值	1,664,918,926.55
期末基金份额净值	0.949

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

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

### 3.2 基金净值表现

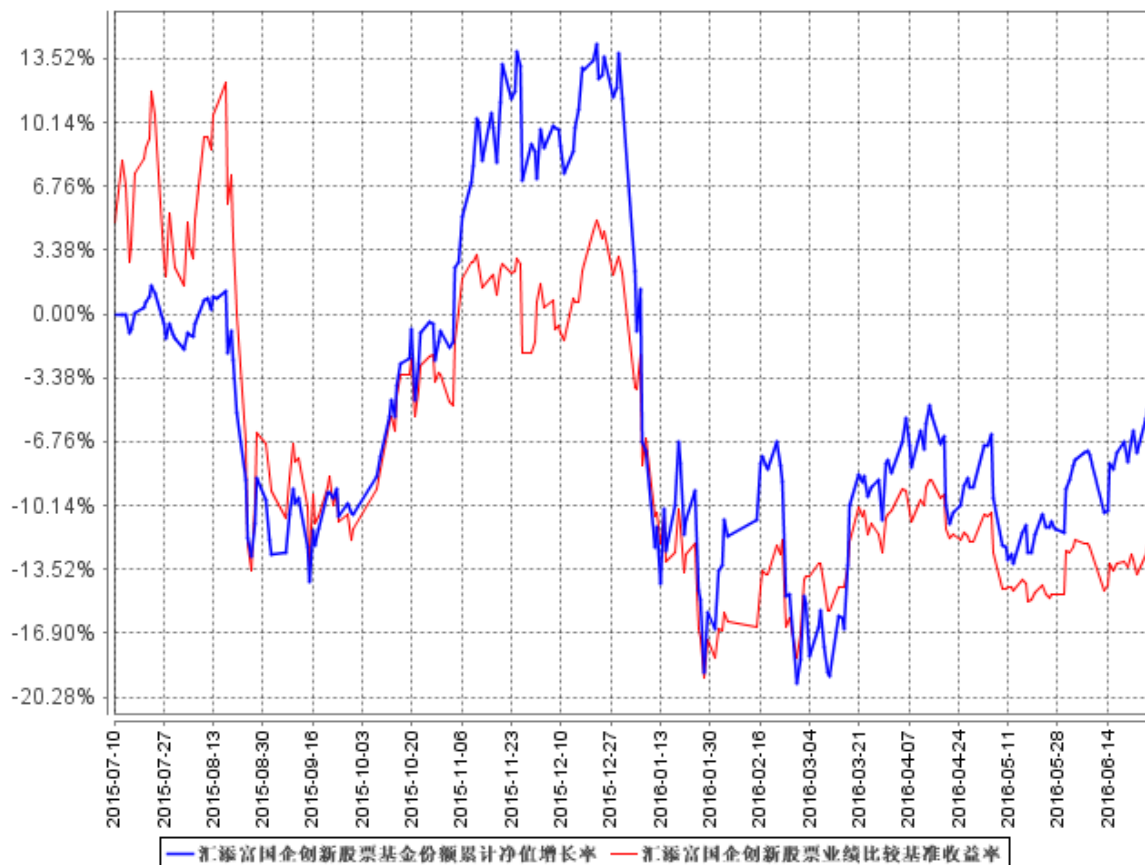
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.63%	1.24%	0.73%	0.86%	3.90%	0.38%
过去三个月	2.82%	1.37%	-1.50%	0.94%	4.32%	0.43%
过去六个月	-14.81%	2.37%	-13.68%	1.66%	-1.13%	0.71%
自基金合同生效日起至 今	-5.10%	2.02%	-11.21%	1.92%	6.11%	0.10%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2015 年 7 月 10 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

汇添富国企创新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 2015 年 7 月 10 日，至本报告期末未满 1 年。基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2015 年 7 月 10 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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 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		
李威	汇添富国企创新股票基金和汇添富外延增长股票基金的基金经理、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富双利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的基金经理助理。	2015 年 7 月 10 日	-	7 年	国籍：中国。学历：清华大学工学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2008 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司任行业分析师，2015 年 1 月 29 日至今任汇添富外延增长股票基金的基金经理。2015 年 5 月 25 日至今任汇添富可转换债券基金、汇添富双利债券基金、汇添富双利增强债券基金的基金经理助理，2015 年 7 月 10 日至今任汇添富国企创新股票基金的基金经理。
劳杰男	汇添富价值精选混合基金、汇添富国企创新股票基金的基金经理，研究副总监。	2015 年 7 月 10 日	-	6 年	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任研究副总监。2015 年 7 月 10 日至今任汇添富国企创新股票基金的基金经理，2015 年 11 月 18 日至今任汇添富价值精选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 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，由于组合投资策略导致。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

上半年经济政策形势动荡较大。年初汇率对货币政策取向产生了较大的影响，被动紧缩的预



期导致市场快速下跌。G20 会议后，汇率预期稳定，国内货币政策开始左右摇摆；美国加息预期多变，英国脱欧成为黑天鹅，局部军事对抗频繁，种种复杂的宏观环境因素和经济因素造成了 a 股随后震荡波动。

上半年上证指数下跌 17.22%，深圳成指下跌 17.17%，中小板指下跌 17.88%，创业板指下跌 17.92%。结构性机会出现在高增长的新能源汽车、增长确定性高的白酒、家电等消费品和供给侧改革受益的部分周期品领域，随着经济军事不确定性增加，黄金股也表现突出。

本基金始终维持在 80%的较低仓位附近。投资方向坚定在改革和创新两大领域，优选国企改革进展较快的区域和产业布局，成长股中坚定持有新能源汽车、医疗服务、智能制造、婴童消费等产业方向优质个股，对周期股做波段操作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年上半年本基金的收益率为-14.81%，业绩比较基准为-13.68%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，本基金观点如下。货币政策约束因素很多，大水漫灌不会再出现。经济情况，财政扩张对冲供给侧改革的负面影响，地产投资很难持续反弹。供给侧改革对未来经济转型提效有重要作用，但是在一段时期内可能造成经济下滑情况超出预期，执行情况需要观察。增发和大小非减持压力大，持续消耗场内资金。改革阻力、创新泡沫客观存在。因此下半年市场情况很难乐观。

本基金下一阶段重点关注以下方面的投资机会：第一，优中选优，坚定持有代表未来方向的成长股，在新能源、医疗服务、智能制造、婴童消费、教育、电商等领域继续深入挖掘；第二，在国企改革中能够提高效率或者改变资产质量的国有企业，重点关注上海、广州等进展较快的区域。

#### 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。

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、基金运营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

具有丰富的证券投资基金行业从业经验，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。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金的《基金合同》规定：在符合有关基金分红的前提下，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国企创新增长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，汇添富国企创新增长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国企创新增长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，汇添富国企创新增长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国企创新增长股票型证券投资基金 2016 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：汇添富国企创新增长股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	242,610,056.58	162,180,293.37
结算备付金	1,328,462.72	5,628,543.35
存出保证金	719,175.09	985,288.08
交易性金融资产	1,431,103,048.05	1,883,356,105.57
其中：股票投资	1,381,103,048.05	1,833,321,105.57
基金投资	-	-
债券投资	50,000,000.00	50,035,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	23,939,000.36
应收利息	1,001,111.01	371,854.10
应收股利	-	-
应收申购款	439,497.30	1,827,182.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,677,201,350.75	2,078,288,266.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016 年 6 月 30 日</b>	<b>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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	4,938,345.02	64,199,627.67
应付赎回款	3,556,922.99	8,691,204.09
应付管理人报酬	2,031,841.88	2,751,102.05
应付托管费	338,640.31	458,517.02
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,198,707.67	3,373,953.92

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	217,966.33	299,011.31
负债合计	12,282,424.20	79,773,416.06
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,754,083,602.37	1,794,460,966.80
未分配利润	-89,164,675.82	204,053,883.98
所有者权益合计	1,664,918,926.55	1,998,514,850.78
负债和所有者权益总计	1,677,201,350.75	2,078,288,266.84

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.949 元，基金份额总额 1,754,083,602.37 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富国企创新增长股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	-269,873,606.15
1.利息收入	1,511,838.99
其中：存款利息收入	890,254.29
债券利息收入	621,584.70
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）	-35,817,416.15
其中：股票投资收益	-39,431,270.49
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	3,613,854.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-236,675,723.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,107,694.16
<b>减：二、费用</b>	19,252,795.71
1. 管理人报酬	12,270,281.66
2. 托管费	2,045,046.92
3. 销售服务费	-

4. 交易费用	4,783,735.43
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	153,731.70
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-289,126,401.86</b>

注：1. 由于本基金于 2015 年 7 月 10 日成立，无比较式上年度可比期间，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：汇添富国企创新增长股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	1,794,460,966.80	204,053,883.98	1,998,514,850.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-289,126,401.86	-289,126,401.86
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）	-40,377,364.43	-4,092,157.94	-44,469,522.37
其中：1.基金申购款	376,044,549.31	-36,865,338.13	339,179,211.18
2.基金赎回款	-416,421,913.74	32,773,180.19	-383,648,733.55
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）	1,754,083,602.37	-89,164,675.82	1,664,918,926.55

注：1、由于本基金于 2015 年 7 月 10 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。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

基金管理人负责人

张晖

主管会计工作负责人

韩从慧

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富国企创新增长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]1116号文《关于准予汇添富国企创新增长股票型证券投资基金注册的批复》的准予注册,由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司作为发起人于2015年7月1日至2015年7月8日止向社会公开募集,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(2015)验字第60466941\_B28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2015年7月10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3,103,651,820.09元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币757,093.94元,以上实收基金(本息)合计为人民币3,104,408,914.03元,折合3,104,408,914.03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)、股票期权、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,精选国企创新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。本基金的业绩比较基准为中证国有企业综合指数 $\times$ 80%+中债综合指数 $\times$ 20%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修改的《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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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[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、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，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。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

### 3、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

### 4、个人所得税

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》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[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[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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。



## 6.4.7 关联方关系

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

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

### 6.4.7.2 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
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关键管理人员

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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 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	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	226,476,449.52	7.27%	-	-

#### 6.4.8.1.2 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。

#### 6.4.8.1.3 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。

### 6.4.8.1.4 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。

### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	206,940.58	7.23%	96,306.92	8.03%

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。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 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	12,270,281.66	-
其中：支付销售机构的客户维护费	5,033,539.30	-

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：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付	2,045,046.92	-

的托管费		
------	--	--

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，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。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 7 月 10 日）持有的基金份额	50,003,500.00	-
期初持有的基金份额	50,003,500.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	50,003,500.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.8507%	-

注：1. 本公司于 2015 年 7 月 7 日用自有资金 50,000,000.00 元认购本基金份额 50,003,500.00 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。

2. 本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末均未投资本基金。

### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	242,610,056.58	855,232.91	-	-

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，2016 年度上半年获得的利息收入为人民币 25,157.67 元，2016 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 1,328,462.72 元。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新股流通受限	12.98	12.98	13,500	175,230.00	175,230.00	-
300520	科大国创	2016 年 6 月 30 日	2016 年 7 月 8 日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002127	南极电商	2016 年 5 月 16 日	重大资产重组	9.63	-	-	12,766,008	90,419,670.26	122,936,657.04	-
000920	南方	2016	重大	17.05	2016	18.10	3,004,395	60,091,250.30	51,224,934.75	-

	汇通	年 2 月 17 日	资产 重组		年 7 月 12 日					
600759	洲际 油气	2016 年 6 月 27 日	重大 资产 重组	7.58	2016 年 7 月 11 日	8.10	3,929,903	33,817,022.86	29,788,664.74	-

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,381,103,048.05	82.35
	其中：股票	1,381,103,048.05	82.35
2	固定收益投资	50,000,000.00	2.98
	其中：债券	50,000,000.00	2.98
	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	243,938,519.30	14.54
7	其他各项资产	2,159,783.40	0.13
8	合计	1,677,201,350.75	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	15,852,107.44	0.95
B	采矿业	45,672,588.74	2.74
C	制造业	836,323,982.51	50.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	120,372,610.09	7.23
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	34,066,768.59	2.05
G	交通运输、仓储和邮政业	22,826,343.36	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	87,863,997.52	5.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	54,516,618.28	3.27
L	租赁和商务服务业	122,936,657.04	7.38
M	科学研究和技术服务业	4,478,126.10	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	19,802,266.30	1.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	13,998,656.98	0.84
Q	卫生和社会工作	2,392,325.10	0.14
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,381,103,048.05	82.95

### 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	600172	黄河旋风	8,213,548	151,375,689.64	9.09
2	600867	通化东宝	6,093,248	126,069,301.12	7.57
3	002127	南极电商	12,766,008	122,936,657.04	7.38
4	300050	世纪鼎利	6,101,008	87,793,505.12	5.27

5	002464	金利科技	1,362,405	83,242,945.50	5.00
6	600886	国投电力	10,020,193	66,133,273.80	3.97
7	600900	长江电力	4,342,621	54,239,336.29	3.26
8	002141	睿胜超微	1,735,597	52,415,029.40	3.15
9	000920	南方汇通	3,004,395	51,224,934.75	3.08
10	300137	先河环保	3,168,386	46,860,428.94	2.81
11	300285	国瓷材料	922,960	36,816,874.40	2.21
12	000609	绵世股份	2,740,439	35,159,832.37	2.11
13	600459	贵研铂业	1,144,900	34,209,612.00	2.05
14	300153	科泰电源	1,109,700	29,950,803.00	1.80
15	600180	瑞茂通	1,971,512	29,789,546.32	1.79
16	600759	洲际油气	3,929,903	29,788,664.74	1.79
17	000590	启迪古汉	1,247,510	27,644,821.60	1.66
18	600449	宁夏建材	2,650,000	23,903,000.00	1.44
19	601021	春秋航空	476,144	22,826,343.36	1.37
20	600161	天坛生物	792,600	22,026,354.00	1.32
21	002655	共达电声	1,236,300	19,966,245.00	1.20
22	600730	中国高科	1,369,907	19,356,785.91	1.16
23	000967	盈峰环境	866,137	19,219,580.03	1.15
24	002094	青岛金王	641,875	17,144,481.25	1.03
25	601666	平煤股份	3,883,600	15,883,924.00	0.95
26	002539	新都化工	1,000,000	15,290,000.00	0.92
27	300201	海伦哲	800,000	15,080,000.00	0.91
28	600661	新南洋	498,883	13,998,656.98	0.84
29	002117	东港股份	440,100	13,845,546.00	0.83
30	000888	峨眉山A	963,000	11,594,520.00	0.70
31	002746	仙坛股份	229,933	9,583,607.44	0.58
32	300407	凯发电气	450,000	8,914,500.00	0.54
33	300420	五洋科技	134,000	8,420,560.00	0.51
34	600520	*ST中发	440,125	8,239,140.00	0.49
35	000826	启迪桑德	268,666	8,207,746.30	0.49
36	600085	同仁堂	224,600	6,690,834.00	0.40
37	600498	烽火通信	260,000	6,312,800.00	0.38
38	002477	雏鹰农牧	1,050,000	6,268,500.00	0.38
39	002350	北京科锐	306,200	6,185,240.00	0.37
40	601028	玉龙股份	670,000	4,783,800.00	0.29
41	002116	中国海诚	300,000	4,458,000.00	0.27
42	000906	物产中拓	279,921	3,322,662.27	0.20
43	002044	美年健康	165,330	2,392,325.10	0.14

44	000593	大通燃气	76,000	954,560.00	0.06
45	601966	玲珑轮胎	13,500	175,230.00	0.01
46	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
47	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
48	603131	上海沪工	842	51,109.40	0.00
49	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
50	603958	哈森股份	2,328	33,756.00	0.00
51	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
52	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
53	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
54	002805	丰元股份	971	5,631.80	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	002141	蓉胜超微	123,350,063.53	6.17
2	600886	国投电力	75,523,157.40	3.78
3	600172	黄河旋风	69,030,039.52	3.45
4	002466	天齐锂业	61,654,986.97	3.09
5	600900	长江电力	53,545,096.46	2.68
6	002133	广宇集团	47,452,387.07	2.37
7	002464	金利科技	46,376,935.81	2.32
8	300153	科泰电源	45,434,512.46	2.27
9	600547	山东黄金	34,959,033.60	1.75
10	000609	绵石投资	34,717,097.47	1.74
11	300050	世纪鼎利	33,841,855.66	1.69
12	600759	洲际油气	33,817,022.86	1.69
13	300285	国瓷材料	33,438,913.99	1.67
14	002127	南极电商	33,416,152.14	1.67
15	002245	澳洋顺昌	32,584,576.88	1.63
16	600449	宁夏建材	27,158,171.00	1.36
17	600161	天坛生物	26,629,368.00	1.33
18	600459	贵研铂业	25,736,632.05	1.29
19	600192	长城电工	24,857,940.12	1.24



20	000975	银泰资源	24,527,236.20	1.23
----	--------	------	---------------	------

注：买入金额按买卖成交金额填列，不考虑相关费用。

#### 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	002466	天齐锂业	184,163,517.97	9.22
2	002141	睿胜超微	72,283,090.16	3.62
3	601166	兴业银行	62,228,506.02	3.11
4	600271	航天信息	54,844,213.94	2.74
5	002133	广宇集团	44,403,565.29	2.22
6	000156	华数传媒	43,462,201.67	2.17
7	600547	山东黄金	40,275,142.58	2.02
8	002004	华邦健康	40,025,522.02	2.00
9	000568	泸州老窖	37,188,477.21	1.86
10	002429	兆驰股份	37,176,779.62	1.86
11	002366	台海核电	34,280,954.13	1.72
12	002245	澳洋顺昌	34,150,563.88	1.71
13	300166	东方国信	33,514,800.77	1.68
14	300050	世纪鼎利	32,262,508.04	1.61
15	002224	三力士	28,826,765.70	1.44
16	600192	长城电工	26,918,363.26	1.35
17	002425	凯撒股份	26,558,185.08	1.33
18	300285	国瓷材料	26,236,204.05	1.31
19	300153	科泰电源	25,876,332.00	1.29
20	000975	银泰资源	25,116,514.36	1.26

注：卖出金额按买卖成交金额填列，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	1,470,034,884.29
卖出股票收入（成交）总额	1,646,180,948.17

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

#### 7.5 期末按债券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	50,000,000.00	3.00
	其中：政策性金融债	50,000,000.00	3.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,000,000.00	3.00

### 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	150219	15 国开 19	500,000	50,000,000.00	3.00

### 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：本基金本报告期末持有股指期货投资。

#### 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投资。

## 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：本基金本报告期无国债期货持仓。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 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、处罚的情况。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 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	719,175.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,001,111.01
5	应收申购款	439,497.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,159,783.40

### 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	002127	南极电商	122,936,657.04	7.38	重大资产重组
2	000920	南方汇通	51,224,934.75	3.08	重大资产重组

## § 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
31,958	54,887.15	62,483,243.73	3.56%	1,691,600,358.64	96.44%

### 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	1,581,320.92	0.0902%

### 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 ( 2015 年 7 月 10 日 ) 基金份额总额	3,104,408,914.03
本报告期期初基金份额总额	1,794,460,966.80

本报告期基金总申购份额	376,044,549.31
减:本报告期基金总赎回份额	416,421,913.74
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,754,083,602.37

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 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

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

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	

平安证券	1	499,768,183.59	16.04%	455,439.15	15.92%	-
德邦证券	1	447,167,656.26	14.35%	416,447.74	14.55%	-
安信证券	2	328,026,088.45	10.53%	299,634.89	10.47%	-
中信证券	2	304,773,609.75	9.78%	277,978.22	9.72%	-
东北证券	2	269,102,986.08	8.64%	245,646.60	8.59%	-
东方证券	3	226,476,449.52	7.27%	206,940.58	7.23%	-
西南证券	2	200,030,310.89	6.42%	182,655.80	6.38%	-
首创证券	1	170,622,763.19	5.48%	158,900.70	5.55%	-
银河证券	2	133,268,740.18	4.28%	121,870.01	4.26%	-
海通证券	1	105,417,468.07	3.38%	98,174.85	3.43%	-
第一创业	1	80,317,856.97	2.58%	74,799.77	2.61%	-
兴业证券	2	75,602,055.74	2.43%	69,459.81	2.43%	-
中信建投	1	69,478,315.58	2.23%	64,704.75	2.26%	-
高华证券	1	61,897,468.28	1.99%	56,407.18	1.97%	-
光大证券	2	39,886,168.45	1.28%	37,146.45	1.30%	-
华泰证券	1	35,453,785.61	1.14%	33,018.33	1.15%	-
招商证券	2	26,767,404.30	0.86%	24,393.13	0.85%	-
国金证券	2	17,011,417.33	0.55%	15,502.55	0.54%	-
国泰君安	2	15,797,674.60	0.51%	14,396.45	0.50%	-
西部证券	1	4,266,613.00	0.14%	3,973.55	0.14%	-
信达证券	1	4,007,684.60	0.13%	3,732.32	0.13%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	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
平安证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-



瑞银证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

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 52 个交易单元与汇添富均衡增长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共用。本报告期退租 6 家证券公司的 6 个交易单元：中银国际（上交所交易单元）、国信证券（上交所交易单元）、湘财证券（上交所交易单元）、日信证券（上交所交易单元）、红塔证券（上交所交易单元）、中航证券（上交所交易单元）。本基金本报告期内新增 2 家证券公司的 2 个交易单元：东方证券（上交所交易单元）、光大证券（上交所交易单元）。

汇添富基金管理股份有限公司  
2016 年 8 月 27 日