

# 汇添富美丽 30 混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

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 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>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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
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.....	38
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.....	39

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
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.....	40
<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>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	<b>错误！未定义书签。</b>
10.9 其他重大事件.....	46
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>错误！未定义书签。</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>50</b>
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富美丽 30 混合型证券投资基金
基金简称	汇添富美丽 30 混合
基金主代码	000173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 6 月 25 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	1,472,000,160.14 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选个股和集中投资，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金的投资组合比例为：60%以上的基金资产投资于股票；其中投资于基金持仓比例最高的前 30；只股票的资产不低于非现金基金资产的 80%；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%；基金持有单只中小企业私募债，其市值不得超过基金资产净值的 10%；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%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 × 80% + 中证全债指数收益率 × 20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

### 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
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		李文	易会满

## 2.4 信息披露方式

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

## 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	97,662,512.50
本期利润	-484,702,031.62
加权平均基金份额本期利润	-0.3281
本期加权平均净值利润率	-17.40%
本期基金份额净值增长率	-13.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,436,988,104.43
期末可供分配基金份额利润	0.9762
期末基金资产净值	2,908,988,264.57
期末基金份额净值	1.976
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	97.60%
-------------	--------

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

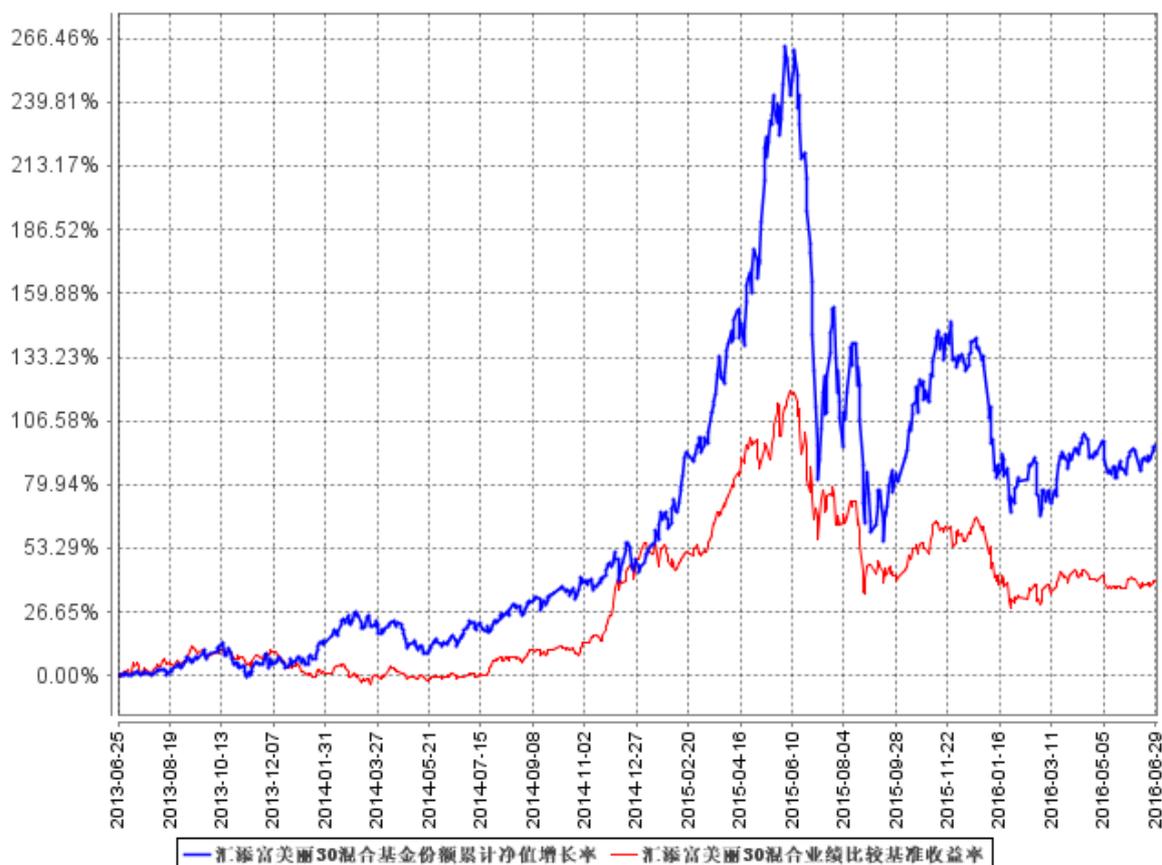
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.51%	1.26%	-0.25%	0.78%	3.76%	0.48%
过去三个月	2.54%	1.42%	-1.52%	0.81%	4.06%	0.61%
过去六个月	-13.90%	2.23%	-12.05%	1.48%	-1.85%	0.75%
过去一年	-28.66%	3.21%	-22.17%	1.84%	-6.49%	1.37%
过去三年	97.40%	2.28%	38.31%	1.47%	59.09%	0.81%
自基金合同生效日起至 今	97.60%	2.27%	40.03%	1.47%	57.57%	0.80%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 06 月 25 日，至本报告期末未满 5 年。

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

汇添富美丽30混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：1. 本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年6月25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。
2. 本基金的《基金合同》生效日为2013年06月25日，至本报告期末未满5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、汇添富收益快线货币市场基金、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	说明
----	----	-----------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
王栩	汇添富优势精选混合基金、汇添富美丽 30 混合基金的基金经理，权益投资总监。	2013 年 6 月 25 日	-	14 年	国籍：中国。学历：同济大学管理学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任上海永嘉投资管理有限公司研究员。2004 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任权益投资总监。2010 年 2 月 5 日至今任汇添富优势精选混合基金的基金经理，2010 年 9 月 21 日至 2013 年 5 月 10 日任汇添富医药保健混合基金的基金经理，2012 年 7 月 10 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富理财 14 天债券基金的基金经理，2013 年 6 月 25 日至今任汇添富美丽 30 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遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合，交易所市场、银行间市场等各投资

市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5% 的交易次数为 1 次，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

2016 年上半年国内经济仍比较低迷，在二季度一度出现阶段性反弹之后再度下滑。主要宏观数据在上半年总体处于下滑趋势，房地产行业是难得的亮点，受益于去库存政策以及宽松的信贷环境今年前五个月全国商品房销售额增长超过 50%。但企业家的投资信心仍然不足，包括房地产行业在内的固定资产投资总体比较低迷，而出口延续了去年以来的负增长态势，总需求不足制约了国内经济的反弹空间。政策方面，政府已经确定以供给侧改革作为宏观调控的主线，因此在房地产去库存之外并未采取大力刺激需求的政策措施，仅仅在三月份为了对冲外汇占款的减少将存款准备金率下调了 0.5 个百分点。国际方面，美联储迟迟未能再度加息，但由于二季度英国脱欧公投意外获得通过，市场的避险需求上升，美元先跌后涨，上半年总体下跌了 2.79%。值得注意的是，黄金、原油以及部分工业金属等商品价格表现强劲，全球持续性的货币宽松使得资产荒成为普遍现象。A 股市场在年初受人民币快速贬值的影响大幅下跌，随后略有反弹，上半年沪深 300 指数下跌 15.47%，中小板指数下跌 17.88%，创业板指数下跌 17.92%。分行业来看，仅食品饮料行业在上半年小幅上涨，有色金属、银行、电子、家用电器等行业跌幅相对较小；传媒、交通运输、商业贸易、休闲服务、公用事业等行业表现相对较差，跌幅均超过 20%。

本基金在上半年根据产业和市场环境的变化对资产配置结构做出调整。期末股票资产比例为 83.6%，较年初下降 5.4 个百分点。行业配置方面，主要增持了农林牧渔、有色金属、医药生物等行业，主要减持了化工、传媒等行业。个股上增加了对低估值价值股、稳健成长股以及资源股

的投资，对于商业模式不够清晰、估值过高的成长股进行了系统性减持。

#### 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-13.9%，比业绩比较基准低 1.85 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

展望下一阶段，本基金认为市场整体仍然相对平衡，部分领域存在比较明显的结构性投资机会。第一，下半年国内经济预计不会出现超预期的下滑，主要的支撑因素是房地产行业的投资将见底回升。今年前五个月房地产行业处于持续景气的状态，销售面积、销售金额同比分别增长 33.2%、50.7%，但房地产投资的增速仅增长 7.0%，远远滞后于销售。在上半年去库存之后，预计房地产企业在下半年将加大投资力度，近期土地市场的火爆即是清晰的征兆。第二，国内货币政策应该不会受到人民币汇率小幅波动的影响，预计仍将保持宽松，这是国内资产价格的重要支撑。从国际环境看，全球经济整体仍然比较低迷，宽松货币政策对于经济的刺激作用逐步减弱，美联储也迟迟未能启动第二次加息，这一状况在较长时间内还看不到变化的可能性。国内货币政策此前受制于人民币贬值的压力，但近期的资本流动状况表明人民币的小幅波动已在市场的预期之内，对货币政策的影响也在减弱。第三，尽管国内经济整体景气度较差，但随着结构转型的进行部分传统产业正在经历深刻的变化，新兴产业也在涌现，提供了结构性的投资机会。市场目前的主要风险还是大量成长股估值偏高，股票供给压力大。二季度我们对于上市公司再融资、大小非减持的担忧正在成为现实。总体而言，下一阶段我们的策略重点还是追求确定性的投资机会，重点关注以下领域。第一，在全球货币泛滥的大环境下确定性回报类的资产缺失是全球投资者面临的共同困境，而在 A 股市场中传统行业的价值股在大部分时间都受到忽视，这一状况有望逐步改变；第二，医疗服务、教育、新兴消费、环保等行业在国内仍然具有非常长的成长期，可以选择其中的优质个股做中长期布局；第三，资源品行业在过去几年大都经历了大规模的产能收缩，全球货币泛滥使得资源品的投资吸引力在上升。

#### 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《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

## **§ 5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，本基金托管人在对汇添富美丽 30 混合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，汇添富美丽 30 混合型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富美丽 30 混合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，汇添富美丽 30 混合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有限公司编制和披露的汇添富美丽 30 混合型证券投资基金 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：汇添富美丽 30 混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	474,961,592.67	341,700,772.60
结算备付金		1,818,392.12	5,584,269.16
存出保证金		903,544.78	1,811,047.33
交易性金融资产	6.4.7.2	2,445,148,642.33	3,198,597,441.37
其中：股票投资		2,445,148,642.33	3,198,597,441.37
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		-	38,989,564.21
应收利息	6.4.7.5	96,429.56	68,087.65
应收股利		-	-
应收申购款		1,363,545.07	5,862,636.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,924,292,146.53	3,592,613,818.38
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 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		-	-
应付赎回款		8,929,298.45	5,447,161.50
应付管理人报酬		3,526,865.18	4,670,237.07
应付托管费		587,810.88	778,372.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,924,138.29	3,814,547.07

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	335,769.16	429,046.20
负债合计		15,303,881.96	15,139,364.72
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,472,000,160.14	1,558,723,214.97
未分配利润	6.4.7.10	1,436,988,104.43	2,018,751,238.69
所有者权益合计		2,908,988,264.57	3,577,474,453.66
负债和所有者权益总计		2,924,292,146.53	3,592,613,818.38

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.976 元，基金份额总额 1,472,000,160.14 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：汇添富美丽 30 混合型证券投资基金

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	附注号	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
<b>一、收入</b>		-454,632,247.48	3,940,263,198.40
1.利息收入		1,759,436.57	2,911,690.98
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,738,186.57	1,848,622.49
债券利息收入		-	1,063,068.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		21,250.00	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		124,800,039.15	2,507,810,768.25
其中：股票投资收益	6.4.7.12	114,517,579.41	2,503,262,847.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-49,500.00
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	10,282,459.74	4,597,420.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-582,364,544.12	1,406,861,723.07
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	1,172,820.92	22,679,016.10
<b>减：二、费用</b>		30,069,784.14	75,265,520.28

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	20,794,231.90	43,967,153.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,465,705.34	7,327,858.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,596,381.68	23,757,502.01
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	213,465.22	213,005.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-484,702,031.62</b>	<b>3,864,997,678.12</b>

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：汇添富美丽 30 混合型证券投资基金

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）	1,558,723,214.97	2,018,751,238.69	3,577,474,453.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-484,702,031.62	-484,702,031.62
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）	-86,723,054.83	-97,061,102.64	-183,784,157.47
其中：1.基金申购款	515,142,677.44	451,980,342.57	967,123,020.01
2.基金赎回款	-601,865,732.27	-549,041,445.21	-1,150,907,177.48
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）	1,472,000,160.14	1,436,988,104.43	2,908,988,264.57
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	2,113,588,292.42	961,738,130.03	3,075,326,422.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,864,997,678.12	3,864,997,678.12
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)	-256,026,998.72	-1,538,115,082.18	-1,794,142,080.90
其中：1.基金申购款	6,753,618,004.57	9,722,256,865.75	16,475,874,870.32
2.基金赎回款	-7,009,645,003.29	-11,260,371,947.93	-18,270,016,951.22
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)	1,857,561,293.70	3,288,620,725.97	5,146,182,019.67

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：

<u>张晖</u>	<u>张晖</u>	<u>韩从慧</u>
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

汇添富美丽 30 混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),原汇添富美丽 30 股票型证券投资基金,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]611 号文《关于核准汇添富美丽 30 股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发行募集,基金合同于 2013 年 6 月 25 日正式生效,首次设立募集规模为 669,054,192.59 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人、注册登记机构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。

根据中国证券监督管理委员会于 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定,经与基金托管人协商一致,汇添富基金管理股份有限公司决定自 2015 年 8 月 5 日起将本基金变更为混合基金,并相应修改本基金的《基金合同》。

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(含国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、债券

回购等)、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款(包括定期存款及协议存款)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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 $\times$ 80%+中证全债指数收益率 $\times$ 20%

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

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

##### 6.4.4.1 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。

## 6.4.5 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。

## 6.4.6 重要财务报表项目的说明

### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	474,961,592.67
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	

合计：	474,961,592.67
-----	----------------

### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,440,648,461.62	2,445,148,642.33	4,500,180.71
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	2,440,648,461.62	2,445,148,642.33	4,500,180.71

### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

### 6.4.6.4 买入返售金融资产

#### 6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	95,327.15
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	736.47
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	365.94
合计	96,429.56

注：“其他”为结算保证金利息。

#### 6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,924,138.29
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,924,138.29

#### 6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	31,890.94
预提费用	303,878.22
合计	335,769.16

#### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,558,723,214.97	1,558,723,214.97
本期申购	515,142,677.44	515,142,677.44
本期赎回(以“-”号填列)	-601,865,732.27	-601,865,732.27
- 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	1,472,000,160.14	1,472,000,160.14

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。

### 6.4.6.10 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	2,088,256,213.03	-69,504,974.34	2,018,751,238.69
本期利润	97,662,512.50	-582,364,544.12	-484,702,031.62
本期基金份额交易产生的变动数	-123,565,744.75	26,504,642.11	-97,061,102.64
其中：基金申购款	691,532,262.44	-239,551,919.87	451,980,342.57
基金赎回款	-815,098,007.19	266,056,561.98	-549,041,445.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,062,352,980.78	-625,364,876.35	1,436,988,104.43

### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	1,690,970.25
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	30,359.73
其他	16,856.59
合计	1,738,186.57

### 6.4.6.12 股票投资收益

#### 6.4.6.12.1 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1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	1,953,479,432.13
减：卖出股票成本总额	1,838,961,852.72
买卖股票差价收入	114,517,579.41

### 6.4.6.13 债券投资收益

注：本基金本期末未持有债券。

#### 6.4.6.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

#### 6.4.6.14 贵金属投资收益

注：本基金本期末未持有贵金属。

#### 6.4.6.15 衍生工具收益

注：本基金本期末未投资衍生工具。

#### 6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	10,282,459.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,282,459.74

#### 6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-582,364,544.12
——股票投资	-582,364,544.12
——债券投资	-
——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	-582,364,544.12

#### 6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	1,172,820.92
合计	1,172,820.92

**6.4.6.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	5,596,381.68
银行间市场交易费用	-
合计	5,596,381.68

**6.4.6.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	44,753.80
信息披露费	159,124.42
银行划款费用	587.00
帐户维护费	9,000.00
合计	213,465.22

**6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.7.1 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。

**6.4.7.2 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。

**6.4.8 关联方关系****6.4.8.1 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。

**6.4.8.2 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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东

汇添富资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富资本管理有限公司	基金管理人施加重大影响的联营企业
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

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。

## 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.1.1 股票交易

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	91,118,893.20	2.52%	3,172,437,784.21	21.00%

#### 6.4.9.1.2 债券交易

注：本基金本期末未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.9.1.3 债券回购交易

注：本基金本期末未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.9.1.4 权证交易

注：本基金本期末未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.9.1.5 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	83,348.29	2.51%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 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	2,810,738.79	20.84%	1,717,844.88	20.39%

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。

## 6.4.9.2 关联方报酬

### 6.4.9.2.1 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	20,794,231.90
其中：支付销售机构的客 户维护费	7,729,881.45	12,571,850.21

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款指令，基金托管人复核后于次月前 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。

### 6.4.9.2.2 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 的托管费	3,465,705.34

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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。

### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期末未与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.9.4.1 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（2013 年 6 月 25 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	4,709,844.56	-
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	4,709,844.56	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.32%	-

注：本基金于 2013 年 6 月 25 日成立。本公司于 2015 年 7 月 6 日用自有资金 10,000,000.00 元申购本基金份额 4,709,844.56 份，申购费用 1,000.00 元。符合招募说明书规定的申购费率。

#### 6.4.9.4.2 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及上年度末均未投资本基金。

### 6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	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	
	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	474,961,592.67	1,690,970.25	295,970,089.98	1,691,116.06

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 上半年度获得的利息收入为人民币 30,359.73 元，2015 上半年度获得的利息收入为人民币 99,498.06 元，2016 上半年末结算备付金余额为 1,818,392.12 元，2015 上半年末结算备付金余额为 6,566,438.12 元。

### 6.4.10 利润分配情况

#### 6.4.10.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

#### 6.4.11.1 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	15,341	199,126.18	199,126.18	-
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	-

#### 6.4.11.2 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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000651	格力电器	2016 年 2 月 22 日	重大事项	22.07	-	-	6,399,916	127,873,052.93	141,246,146.12	-
002127	南极电商	2016 年 5 月 16 日	重大资产	9.63	-	-	6,599,888	63,920,826.53	63,556,921.44	-

			重组							
601611	中国核建	2016年6月30日	重大事项	20.92	2016年7月1日	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-

### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.11.3.1 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。

#### 6.4.11.3.2 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。

### 6.4.12 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能

#### 6.4.12.1 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。

#### 6.4.12.2 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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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。

### 6.4.12.3 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。

#### 6.4.12.3.1 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、部分应收申购款、买入返售金融资产及债券投资等。

##### 6.4.12.3.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	474,961,592.67	-	-	-	-	-	474,961,592.67
结算备付金	1,818,392.12	-	-	-	-	-	1,818,392.12
存出保证金	903,544.78	-	-	-	-	-	903,544.78
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,445,148,642.33	-2,445,148,642.33
应收利息	-	-	-	-	-	96,429.56	96,429.56
应收申购款	24,387.35	-	-	-	-	1,339,157.72	1,363,545.07
资产总计	477,707,916.92	-	-	-	-	-2,446,584,229.61	2,924,292,146.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,929,298.45	8,929,298.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,526,865.18	3,526,865.18
应付托管费	-	-	-	-	-	587,810.88	587,810.88
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,924,138.29	1,924,138.29
其他负债	-	-	-	-	-	335,769.16	335,769.16
负债总计	-	-	-	-	-	15,303,881.96	15,303,881.96

利率敏感度缺口	477,707,916.92	-	-	-	-	-2,431,280,347.65	2,908,988,264.57
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	341,700,772.60	-	-	-	-	-	341,700,772.60
结算备付金	5,584,269.16	-	-	-	-	-	5,584,269.16
存出保证金	1,811,047.33	-	-	-	-	-	1,811,047.33
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-3,198,597,441.37	3,198,597,441.37
应收证券清算款	-	-	-	-	-	38,989,564.21	38,989,564.21
应收利息	-	-	-	-	-	68,087.65	68,087.65
应收申购款	400,001.75	-	-	-	-	5,462,634.31	5,862,636.06
资产总计	349,496,090.84	-	-	-	-	-3,243,117,727.54	3,592,613,818.38
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,447,161.50	5,447,161.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,670,237.07	4,670,237.07
应付托管费	-	-	-	-	-	778,372.88	778,372.88
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,814,547.07	3,814,547.07
其他负债	-	-	-	-	-	429,046.20	429,046.20
负债总计	-	-	-	-	-	15,139,364.72	15,139,364.72
利率敏感度缺口	349,496,090.84	-	-	-	-	-3,227,978,362.82	3,577,474,453.66

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

### 6.4.12.3.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	银行存款、结算备付金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响；		
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券。		
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 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	0.25%	-	-
	-0.25%	-	-

### 6.4.12.3.2 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和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.12.3.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 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	2,445,148,642.33	84.05	3,198,597,441.37	89.41
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	2,445,148,642.33	84.05	3,198,597,441.37	89.41

注：本基金 60%以上的基金资产投资于股票；其中投资于基金持仓比例最高的前 30 只股票的资产不低于非现金基金资产的 80%；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%；基金持有单只中小企业私募债，其市值不得超过基金资产净值的 10%；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%。

#### 6.4.12.3.2.2 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，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 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	5%	206,789,773.32	149,308,661.08
	-5%	-206,789,773.32	-149,308,661.08

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。

#### 6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,445,148,642.33	83.62
	其中：股票	2,445,148,642.33	83.62
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	476,779,984.79	16.30
7	其他各项资产	2,363,519.41	0.08
8	合计	2,924,292,146.53	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	103,757,964.50	3.57
B	采矿业	50,583,000.00	1.74

C	制造业	939,296,069.85	32.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	775,274.28	0.03
F	批发和零售业	295,005,768.13	10.14
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	447,843,506.70	15.40
J	金融业	227,704,689.36	7.83
K	房地产业	11,979,383.83	0.41
L	租赁和商务服务业	63,556,921.44	2.18
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
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	296,830,566.14	10.20
R	文化、体育和娱乐业	7,795,372.00	0.27
S	综合	-	-
	合计	2,445,148,642.33	84.05

### 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	002044	美年健康	16,203,976	234,471,532.72	8.06
2	300359	全通教育	5,300,000	157,198,000.00	5.40
3	601318	中国平安	4,800,000	153,792,000.00	5.29
4	000651	格力电器	6,399,916	141,246,146.12	4.86
5	300033	同花顺	1,588,134	129,353,514.30	4.45
6	600180	瑞茂通	6,800,000	102,748,000.00	3.53
7	000333	美的集团	4,199,844	99,620,299.68	3.42
8	002299	圣农发展	3,502,655	90,718,764.50	3.12
9	002095	生意宝	1,600,000	89,584,000.00	3.08
10	601166	兴业银行	4,849,914	73,912,689.36	2.54
11	002589	瑞康医药	2,399,995	73,703,846.45	2.53

12	002094	青岛金王	2,600,000	69,446,000.00	2.39
13	002640	跨境通	3,800,000	66,956,000.00	2.30
14	000590	启迪古汉	2,875,689	63,725,268.24	2.19
15	002428	云南锗业	3,699,988	63,565,793.84	2.19
16	002127	南极电商	6,599,888	63,556,921.44	2.18
17	600763	通策医疗	1,999,969	62,359,033.42	2.14
18	600446	金证股份	1,650,000	59,317,500.00	2.04
19	300252	金信诺	1,649,904	54,661,319.52	1.88
20	000967	盈峰环境	2,424,260	53,794,329.40	1.85
21	600547	山东黄金	1,300,000	50,583,000.00	1.74
22	600702	沱牌舍得	1,999,989	50,479,722.36	1.74
23	002030	达安基因	1,650,000	45,870,000.00	1.58
24	300147	香雪制药	2,600,000	38,298,000.00	1.32
25	002390	信邦制药	3,900,000	36,036,000.00	1.24
26	600559	老白干酒	1,499,755	35,934,129.80	1.24
27	600750	江中药业	1,000,000	31,800,000.00	1.09
28	000906	物产中拓	2,399,932	28,487,192.84	0.98
29	002396	星网锐捷	1,309,800	25,803,060.00	0.89
30	600478	科力远	1,950,000	23,536,500.00	0.81
31	002652	扬子新材	1,800,000	23,184,000.00	0.80
32	600694	大商股份	599,967	23,110,728.84	0.79
33	002035	华帝股份	812,090	19,879,963.20	0.68
34	600080	金花股份	1,665,000	19,480,500.00	0.67
35	000708	大冶特钢	1,248,667	13,985,070.40	0.48
36	600211	西藏药业	297,763	13,208,766.68	0.45
37	300498	温氏股份	360,000	13,039,200.00	0.45
38	000609	绵世股份	933,701	11,979,383.83	0.41
39	300026	红日药业	500,000	8,695,000.00	0.30
40	300364	中文在线	149,911	7,795,372.00	0.27
41	002405	四维图新	300,000	7,380,000.00	0.25
42	002773	康弘药业	129,750	6,039,862.50	0.21
43	300253	卫宁健康	200,000	4,940,000.00	0.17
44	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.03
45	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
46	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
47	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
48	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
49	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
50	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00

51	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
52	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
53	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
54	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
55	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
56	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	300033	同花顺	123,810,318.49	3.46
2	002299	圣农发展	86,126,058.81	2.41
3	600763	通策医疗	71,278,558.43	1.99
4	002127	南极电商	63,920,826.53	1.79
5	002428	云南锗业	59,837,861.44	1.67
6	600547	山东黄金	58,642,665.05	1.64
7	600446	金证股份	58,398,416.43	1.63
8	300147	香雪制药	53,614,009.44	1.50
9	002094	青岛金王	52,380,201.99	1.46
10	000967	盈峰环境	49,428,121.99	1.38
11	300252	金信诺	47,490,800.80	1.33
12	600702	沱牌舍得	45,144,499.75	1.26
13	002652	扬子新材	40,461,503.07	1.13
14	600750	江中药业	37,894,719.70	1.06
15	600559	老白干酒	34,586,291.84	0.97
16	300498	温氏股份	33,346,721.53	0.93
17	002589	瑞康医药	31,506,903.96	0.88
18	000906	物产中拓	31,402,232.49	0.88
19	002095	生意宝	31,284,489.27	0.87
20	600216	浙江医药	30,310,056.95	0.85

注：本项“买入金额”按卖出成交金额填列，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	002018	华信国际	437,045,031.40	12.22
2	600016	民生银行	101,488,028.29	2.84
3	300168	万达信息	100,942,654.18	2.82
4	000869	张裕 A	89,211,293.30	2.49
5	002659	中泰桥梁	79,804,031.09	2.23
6	600585	海螺水泥	60,560,529.18	1.69
7	300359	全通教育	59,985,859.87	1.68
8	002640	跨境通	52,918,200.44	1.48
9	300028	金亚科技	51,839,182.75	1.45
10	600570	恒生电子	47,254,672.00	1.32
11	600136	当代明诚	45,867,527.87	1.28
12	600666	奥瑞德	39,381,981.42	1.10
13	300207	欣旺达	36,618,146.72	1.02
14	600478	科力远	31,870,496.18	0.89
15	600216	浙江医药	29,839,365.25	0.83
16	300324	旋极信息	28,904,953.41	0.81
17	002341	新纶科技	28,536,690.00	0.80
18	000538	云南白药	27,838,337.20	0.78
19	000776	广发证券	27,575,921.33	0.77
20	600641	万业企业	26,082,609.24	0.73

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	1,667,877,597.80
卖出股票收入（成交）总额	1,953,479,432.13

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

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。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末持有股指期货。

**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**

本基金本报告期末持有国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	903,544.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	96,429.56
5	应收申购款	1,363,545.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	2,363,519.41

### 7.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000651	格力电器	141,246,146.12	4.86	重大事项

## § 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
105,367	13,970.22	147,282,906.78	10.01%	1,324,717,253.36	89.99%

### 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	1,550,900.08	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	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年6月25日）基金份额总额	669,054,192.59
本报告期期初基金份额总额	1,558,723,214.97
本报告期基金总申购份额	515,142,677.44
减：本报告期基金总赎回份额	601,865,732.27
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	1,472,000,160.14

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人 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，曾刚先生和李怀定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	
安信证券	2	516,219,445.51	14.26%	470,433.34	14.16%	-
齐鲁证券	2	505,898,146.43	13.98%	463,067.78	13.94%	-
中金公司	2	340,028,301.81	9.39%	312,085.52	9.40%	-
方正证券	1	316,549,006.98	8.74%	288,471.44	8.68%	-
中银国际	1	278,990,149.06	7.71%	259,822.21	7.82%	-
西南证券	1	235,229,055.05	6.50%	214,363.71	6.45%	-
联合证券	1	216,035,012.17	5.97%	196,873.37	5.93%	-
国信证券	1	174,217,040.94	4.81%	158,764.71	4.78%	-
上海证券	1	166,469,105.30	4.60%	155,032.31	4.67%	-
兴业证券	2	157,440,748.14	4.35%	143,627.85	4.32%	-
国都证券	1	125,765,206.24	3.47%	117,124.96	3.53%	-
东方证券	2	91,118,893.20	2.52%	83,348.29	2.51%	-
长江证券	1	81,718,535.37	2.26%	76,104.80	2.29%	-
招商证券	2	81,147,011.81	2.24%	75,224.80	2.26%	-
银河证券	2	80,924,350.96	2.24%	74,008.46	2.23%	-
华融证券	2	66,268,238.46	1.83%	60,390.31	1.82%	-
中信建投	1	39,792,174.64	1.10%	37,058.50	1.12%	-
东兴证券	1	34,711,162.91	0.96%	32,326.08	0.97%	-
国金证券	2	32,197,679.30	0.89%	29,985.91	0.90%	-
申银万国	1	32,080,019.56	0.89%	29,875.77	0.90%	-
民族证券	1	30,936,225.20	0.85%	28,811.15	0.87%	-
国泰君安	2	12,091,277.04	0.33%	11,260.68	0.34%	-
海通证券	1	3,988,429.00	0.11%	3,714.46	0.11%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-

中投证券	1	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-
华鑫证券	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
安信证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	150,000,000.00	100.00%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-

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 44 个交易单元与汇添富成长焦点混合型证券投资基金、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金、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共用。本报告期退租 1 家证券公司的 1 个交易单元：联合证券（上交所交易单元）。本基金本报告期内新增 3 家证券公司的 4 个交易单元：华融证券（上交所交易单元）、华融证券（深交所交易单元）、安信证券（深交所交易单元）、西南证券（深交所交易单元）。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富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 年 1 月 4 日
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 年 1 月 4 日
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 年 1 月 4 日
4	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 (旋极信息、郑煤机、立思辰、金证股份)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 1 月 5 日
5	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 年 1 月 7 日
6	汇添富美丽 30 混合型证券投资基金更新招募说明书及摘要 (2015 年第 2 号)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 1 月 16 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与渤海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 年 1 月 20 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关	中国证券报, 上海证	2016 年 1 月 20 日

	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	券报, 证券时报, 管理人网站	
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(金亚科技)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 1 月 26 日
10	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 年 1 月 27 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中正达广为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 2 月 1 日
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 年 2 月 18 日
13	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 年 2 月 20 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东证期货为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 2 月 24 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 年 2 月 24 日
16	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(岭南园林、格力)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 2 月 26 日

	电器)		
17	汇添富基金管理股份有限公司关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	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 2 月 27 日
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 年 3 月 16 日
19	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 年 3 月 28 日
20	汇添富基金管理股份有限公司关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	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 3 月 31 日
21	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 年 4 月 2 日
22	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加格上富信为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 4 月 27 日
23	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加乾道金融为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 5 月 3 日
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 年 5 月 12 日
25	汇添富基金管理股份有限公司关	中国证券报, 上海证	2016 年 5 月 17 日

	于旗下部分基金增加和耕传承为销售机构的公告	券报, 证券时报, 管理人网站	
26	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大连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	2016 年 5 月 27 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汇成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	2016 年 6 月 4 日
28	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加葱次方为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 6 月 13 日
29	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加广源达信为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 6 月 14 日
30	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中信证券开展的申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	2016 年 6 月 16 日
31	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加联泰资产开展的申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	2016 年 6 月 17 日
32	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加富滇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	2016 年 6 月 17 日
33	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加陆金所资管开展的申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	2016 年 6 月 24 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美丽 30 混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富美丽 30 混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富美丽 30 混合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、报告期内汇添富美丽 30 混合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  
2016 年 8 月 27 日