

# 汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	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>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47

7.13 投资组合报告附注.....	47
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>55</b>
11.1 备查文件目录.....	55
11.2 存放地点.....	55
11.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	汇添富深证 300ETF 联接
基金主代码	470068
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 28 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	43,050,545.10 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159912
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 16 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 11 月 24 日
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以深证 300 交易型开放式指数证券投资基金作为其主要投资标的，并不参与目标 ETF 的管理。本基金主要以一级市场申购的方式投资于目标 ETF，获取基金份额净值上涨带来的收益；在目标 ETF 基金份额二级市场交易流动性较好的情况下，也可以通过二级市场买卖目标 ETF 的基金份额。
业绩比较基准	深证 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收

	益特征。
--	------

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法。正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	深证 300 指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 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	-1,937,113.05
本期利润	-10,212,752.38
加权平均基金份额本期利润	-0.2439
本期加权平均净值利润率	-18.77%
本期基金份额净值增长率	-16.05%
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	14,107,919.33
期末可供分配基金份额利润	0.3277
期末基金资产净值	57,518,638.54
期末基金份额净值	1.3361
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	33.61%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

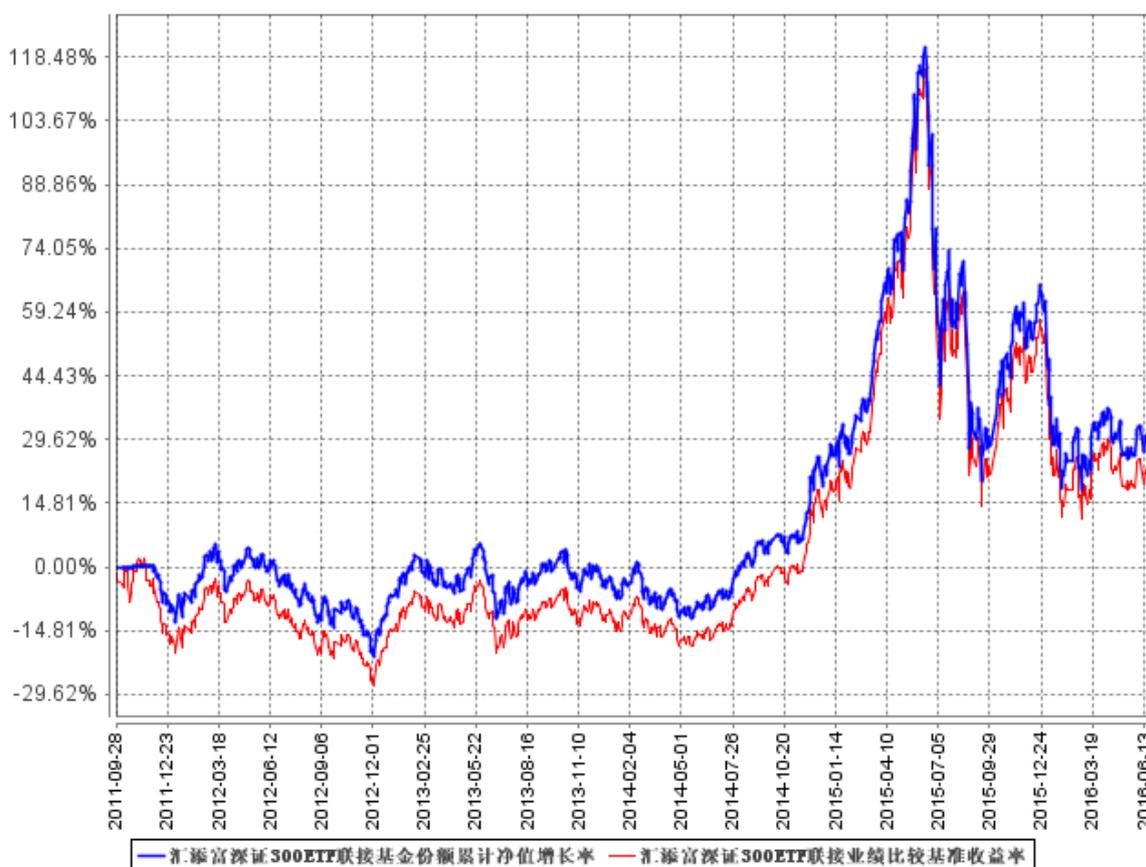
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.30%	1.29%	2.29%	1.32%	0.01%	-0.03%
过去三个月	0.11%	1.33%	-0.40%	1.37%	0.51%	-0.04%
过去六个月	-16.05%	2.14%	-16.56%	2.20%	0.51%	-0.06%
过去一年	-25.26%	2.48%	-26.71%	2.53%	1.45%	-0.05%

过去三年	49.72%	1.85%	55.32%	1.88%	-5.60%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	33.61%	1.66%	25.86%	1.72%	7.75%	-0.06%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 9 月 28 日，至本报告期末未满五年。

### 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

汇添富深证 300ETF 联接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 2011 年 9 月 28 日，截至本报告期末，基金成立未满 5 年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011 年 9 月 28 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日

正式成立，注册资本为 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、汇添富医药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		
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 (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。	2015 年 1 月 6 日	-	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。
过蓓	汇添富中证主要消费 ETF、汇添富中证医药卫生 ETF、汇添富中证能源 ETF、汇添富中证金融地产 ETF、汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证	2015 年 8 月 18 日	-	5 年	国籍：中国，学历：中国科学技术大学金融工程博士研究生，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理，2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费 ETF 基金、中证医药卫生 ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金、汇添富中证主要消费 ETF 联接基金的基金经理，2015 年 8 月 18 日至今任汇添富深证 300ETF 基金、汇

	300ETF 联接基金、汇添富主要消费 ETF 联接基金的基金经理。			添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理。
--	------------------------------------	--	--	--------------------------

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

2016 年上半年沪深 300 指数下跌 15.47%，全球主要股指先抑后扬出现企稳震荡行情。全球经  
济表现依旧不佳，美国宽松货币政策不断延期以解决经济增长乏力和结构性失业的问题，大选落  
定前年内加息概率几无，在一定程度上缓解了中国资本流出的压力。同时，货币宽松到负利率阶  
段，对经济增长的边际作用越来越弱，对信用货币体系也带来冲击，黄金、大宗商品、房地产、  
债券市场受益于宽松的货币环境和动荡的政治局势，成为 2016 年上半年表现最好的投资品种。

本基金在报告期内遵循了指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性，股票投资  
仓位在考察期内始终保持在 90%~95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。本基  
金日常管理中非常重视风险管理，对股票和现金头寸严格管理、实时监控，基本实现了基金平稳  
运作管理的目的。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内深证 300 联接基准下跌-16.56%，本基金在报告期内累计收益率为-16.05%，收益率  
超越业绩比较基准 0.51%。收益率的差异因素主要来源于期间成份股分红、日常申购赎回等因素。  
本基金日均跟踪误差为 0.0535%，这一跟踪误差水平远低于合同约定上限，在报告期达到了投资  
目标。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年上半年政策着力于稳增长，货币环境较为宽松；下半年货币政策继续主动放松的空间  
不大，而供给侧改革、扩大总需求、国企改革将成为着力点，引导货币脱虚向实，引导经济去产  
能、去杠杆。A 股市场趋势性机会仍需等待，但是结构性行情已经向业绩和价值投资转换，情绪  
面较为乐观。

作为被动投资的指数型基金，汇添富深证 300ETF 联接基金将严格遵守基金合同，继续坚持既  
定的指数化投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。

#### 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 6 次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日可供分配利润的 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深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，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，汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、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

富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接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深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 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：汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
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	2,993,701.61	4,437,780.21
结算备付金		15,385.35	49,862.62
存出保证金		7,171.83	20,967.78
交易性金融资产	6.4.7.2	54,584,237.63	63,171,435.30
其中：股票投资		1,891,249.80	2,387,612.46
基金投资		52,692,787.83	60,783,322.84
债券投资		200.00	500.00
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		258,818.08	10,335.73
应收利息	6.4.7.5	589.72	840.54
应收股利		-	-
应收申购款		80,740.38	262,803.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		57,940,644.60	67,954,025.48
<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		288,657.57	413,971.07
应付管理人报酬		1,682.55	2,591.91
应付托管费		336.53	518.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,612.13	23,065.71
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	125,717.28	131,464.27
负债合计		422,006.06	571,611.32
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	43,050,545.10	42,337,461.72
未分配利润	6.4.7.10	14,468,093.44	25,044,952.44
所有者权益合计		57,518,638.54	67,382,414.16
负债和所有者权益总计		57,940,644.60	67,954,025.48

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3361 元，基金份额总额 43,050,545.10 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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 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
<b>一、收入</b>		-10,107,688.14	25,298,237.05
1.利息收入		12,354.30	20,228.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,354.07	20,228.51
债券利息收入		0.23	0.16
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）		-1,878,747.17	15,812,418.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-566,007.10	358,703.04
基金投资收益	6.4.7.13	-1,321,829.36	15,446,994.88
债券投资收益	6.4.7.14	47.24	344.17
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	-	-
股利收益	6.4.7.17	9,042.05	6,376.89
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-8,275,639.33	9,195,110.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	34,344.06	270,478.93
<b>减：二、费用</b>		105,064.24	279,939.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,426.92	15,479.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,285.37	3,095.92
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	26,651.19	196,841.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	64,700.76	64,522.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-10,212,752.38	25,018,297.29

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：汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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）	42,337,461.72	25,044,952.44	67,382,414.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,212,752.38	-10,212,752.38
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）	713,083.38	-364,106.62	348,976.76
其中：1. 基金申购款	21,908,733.68	6,631,452.95	28,540,186.63
2. 基金赎回款	-21,195,650.30	-6,995,559.57	-28,191,209.87
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)	43,050,545.10	14,468,093.44	57,518,638.54
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)	49,068,118.96	11,454,575.57	60,522,694.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,018,297.29	25,018,297.29
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)	-2,731,765.18	22,448.25	-2,709,316.93
其中：1. 基金申购款	137,697,073.48	92,399,189.75	230,096,263.23
2. 基金赎回款	-140,428,838.66	-92,376,741.50	-232,805,580.16
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)	46,336,353.78	36,495,321.11	82,831,674.89

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

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

汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（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[2011]886 号文《关于核准汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开发行募集，基金合同于 2011 年 9 月 28 日正式生效，首次设立募集规模为 336,005,348.19 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与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。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、目标 ETF、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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（但需符合中国证监会的相关规定）。本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股。本基金业绩比较基准为：深证 300 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于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相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 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。

#### 6.4.6.2 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。

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 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 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 6 月 30 日
活期存款	2,993,701.61
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	2,993,701.61

注：本基金本期末未投资于定期存款。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,855,211.72	1,891,249.80	36,038.08

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	200.00	200.00
	银行间市场	-	-
	合计	200.00	200.00
资产支持证券	-	-	-
基金	56,639,836.17	52,692,787.83	-3,947,048.34
其他	-	-	-
合计	58,495,247.89	54,584,237.63	-3,911,010.26

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	577.06
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	9.73
应收债券利息	0.05
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	2.88
合计	589.72

注：“其他”为应收交易保证金利息。

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,612.13
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,612.13

**6.4.7.8 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	1,074.52
预提审计费	19,890.78
预提信息披露费	104,751.98
合计	125,717.28

**6.4.7.9 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	42,337,461.72	42,337,461.72
本期申购	21,908,733.68	21,908,733.68
本期赎回(以“-”号填列)	-21,195,650.30	-21,195,650.30
- 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	43,050,545.10	43,050,545.10

注：本期申购中包含转换入份额，本期赎回中包含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,933,319.21	9,111,633.23	25,044,952.44
本期利润	-1,937,113.05	-8,275,639.33	-10,212,752.38
本期基金份额交易	111,713.17	-475,819.79	-364,106.62

产生的变动数			
其中：基金申购款	7,478,940.60	-847,487.65	6,631,452.95
基金赎回款	-7,367,227.43	371,667.86	-6,995,559.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,107,919.33	360,174.11	14,468,093.44

#### 6.4.7.11 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	11,451.60
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	262.60
其他	639.87
合计	12,354.07

注：“其他”包括交易保证金利息收入、直销申购款利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-216,191.75
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-349,815.35
合计	-566,007.10

##### 6.4.7.12.2 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	8,381,117.46
减：卖出股票成本总额	8,597,309.21
买卖股票差价收入	-216,191.75

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	11,730,880.00
减：现金支付申购款总额	721,000.67
减：申购股票成本总额	11,412,667.18
加：申购可收退补款	52,972.50
申购差价收入	-349,815.35

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	10,220,281.80
减：卖出/赎回基金成本总额	11,542,111.16
基金投资收益	-1,321,829.36

#### 6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	547.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	500.00
减：应收利息总额	0.26
买卖债券差价收入	47.24

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本期末未投资资产支持证券。

##### 6.4.7.15 贵金属投资收益

###### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本期末未投资贵金属。

###### 6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本期末未投资贵金属。

### 6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本期末未投资贵金属。

### 6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本期末未投资贵金属。

### 6.4.7.16 衍生工具收益

#### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本期末未投资衍生工具。

#### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本期末未投资衍生工具。

### 6.4.7.17 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	9,042.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,042.05

### 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 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-8,275,639.33
——股票投资	988.78
——债券投资	-
——基金投资	-8,276,628.11
——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	-8,275,639.33

#### 6.4.7.19 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	34,344.06
合计	34,344.06

#### 6.4.7.20 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	26,651.19
银行间市场交易费用	-
合计	26,651.19

#### 6.4.7.21 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	19,890.78
信息披露费	44,751.98
银行划款费用	58.00
合计	64,700.76

### 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、基金注册登记机构
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
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

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 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	18,269,875.81	100.00%	129,249,717.86	100.00%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东方证券股份有限公司	547.50	100.00%	1,044.48	100.00%

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期末与关联方进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 基金交易**

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	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方证券股份有限公司	125,874.50	100.00%	28,380.00	100.00%

**6.4.10.1.5 权证交易**

注：本基金本报告期末与关联方进行权证交易。

**6.4.10.1.6 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	16,643.10	100.00%	5,612.13	100.00%
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	114,370.57	100.00%	63,384.39	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 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	11,426.92	15,479.44
其中：支付销售机构的客户维护费	31,267.19	41,443.09

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产

净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	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	2,285.37	3,095.92

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.1% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

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前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金的基金管理人本报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

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。

**6.4.10.5 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		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	2,993,701.61	11,451.60	4,316,932.91	16,910.98

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1月1日至2016年6月30日止期间获得的利息收入为人民币262.60元，2016年6月30日结算备付金余额为人民币15,385.35元。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本报告期末，本基金持有 40,614,142 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 91.61%。

**6.4.11 利润分配情况****6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项停牌	22.07	-	-	2,400	46,128.00	52,968.00	-
000002	万科A	2015年12月18日	资产重组	18.21	2016年7月4日	21.99	2,900	70,847.00	52,809.00	-

			停牌							
000728	国元证券	2016年6月8日	重大事项停牌	16.72	2016年7月8日	17.37	1,200	19,529.64	20,064.00	-
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项停牌	12.44	-	-	900	11,182.91	11,196.00	-
000547	航天发展	2016年4月19日	重大资产重组停牌	15.36	-	-	400	6,144.00	6,144.00	-
300032	金龙机电	2016年6月28日	重大事项停牌	20.10	2016年7月7日	19.80	300	5,721.00	6,030.00	-
002280	联络互动	2016年4月25日	重大资产重组停牌	19.71	-	-	300	5,913.00	5,913.00	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项停牌	8.29	-	-	700	5,803.00	5,803.00	-
300166	东方国信	2016年6月8日	重大资产重组停牌	28.23	-	-	200	5,494.00	5,646.00	-
000511	*ST 烯碳	2016年4月26日	重大事项停牌	8.92	-	-	600	5,352.00	5,352.00	-
000629	*ST 钒钛	2016年5月26日	重大资产重组停牌	2.39	-	-	2,200	5,426.11	5,258.00	-
002266	浙富控股	2016年5月25日	重大事项停牌	5.35	-	-	900	4,880.03	4,815.00	-
002190	成飞集成	2016年4月21日	重大事项停牌	35.44	2016年7月12日	38.98	100	3,544.00	3,544.00	-
000401	冀东水泥	2016年4月6日	重大资产重组停牌	10.90	2016年7月14日	11.32	300	3,270.00	3,270.00	-
000975	银泰资源	2016年4月19日	重大资产	15.00	-	-	200	3,000.00	3,000.00	-

		日	重组 停牌							
300052	中青 宝	2016 年 6 月 8 日	重大 资产 重组 停牌	22.03	-	-	100	2,203.00	2,203.00	-
000693	ST 华 泽	2016 年 3 月 1 日	重大 事项 停牌	12.50	-	-	100	1,250.00	1,250.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

#### 6.4.12.3.2 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	200.00	-
未评级	-	-
合计	200.00	-

### 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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

### 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 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	2,993,701.61	-	-	-	-	-	2,993,701.61
结算备付金	15,385.35	-	-	-	-	-	15,385.35
存出保证金	7,171.83	-	-	-	-	-	7,171.83
交易性金融资产	-	-	200.00	-	-	54,584,037.63	54,584,237.63

应收证券清算款	-	-	-	-	-	258,818.08	258,818.08
应收利息	-	-	-	-	-	589.72	589.72
应收申购款	69,630.56	-	-	-	-	11,109.82	80,740.38
资产总计	3,085,889.35	-	200.00	-	-	54,854,555.25	57,940,644.60
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	288,657.57	288,657.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,682.55	1,682.55
应付托管费	-	-	-	-	-	336.53	336.53
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,612.13	5,612.13
其他负债	-	-	-	-	-	125,717.28	125,717.28
负债总计	-	-	-	-	-	422,006.06	422,006.06
利率敏感度缺口	3,085,889.35	-	200.00	-	-	54,432,549.19	57,518,638.54
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	4,437,780.21	-	-	-	-	-	4,437,780.21
结算备付金	49,862.62	-	-	-	-	-	49,862.62
存出保证金	20,967.78	-	-	-	-	-	20,967.78
交易性金融资产	-	-	-	-	500.00	63,170,935.30	63,171,435.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,335.73	10,335.73
应收利息	-	-	-	-	-	840.54	840.54
应收申购款	148,470.27	-	-	-	-	114,333.03	262,803.30
资产总计	4,657,080.88	-	0.00	-	500.00	63,296,444.60	67,954,025.48
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	413,971.07	413,971.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,591.91	2,591.91
应付托管费	-	-	-	-	-	518.36	518.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	23,065.71	23,065.71
其他负债	-	-	-	-	-	131,464.27	131,464.27
负债总计	-	-	-	-	-	571,611.32	571,611.32
利率敏感度缺口	4,657,080.88	-	0.00	-	500.00	62,724,833.28	67,382,414.16

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：基金持有的可转债的市场风险在附注 6.4.13.4.3.2 中进行披露；除此之外，本基金本报告期末及上年度末计息资产仅包括银行存款、部分应收申购款、结算备付金及存出保证金，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 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	1,891,249.80	3.29	2,387,612.46	3.54
交易性金融资产-基金投资	52,692,787.83	91.61	60,783,322.84	90.21
交易性金融资产-债券投资	200.00	0.00	500.00	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	54,584,237.63	94.90	63,171,435.30	93.75

注：本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、目标 ETF、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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（但需符合中国证监会的相关规定）。本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股。其中投资于目标 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 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，即与所投资证券的贝塔
----	-------------------------------------

	系数密切相关；		
	对于上市时间不足一年的股票，使用申银万国行业指数替代股票价格计算其贝塔系数；		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	深证 300 指数上涨 5%	2,811,059.99	3,134,946.41
	深证 300 指数下跌 5%	-2,811,059.99	-3,134,946.41

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,891,249.80	3.26
	其中：股票	1,891,249.80	3.26
2	基金投资	52,692,787.83	90.94
3	固定收益投资	200.00	0.00
	其中：债券	200.00	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,009,086.96	5.19
8	其他各项资产	347,320.01	0.60
9	合计	57,940,644.60	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	25,969.80	0.05
B	采矿业	26,318.00	0.05
C	制造业	1,101,789.73	1.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,012.00	0.05
E	建筑业	29,596.40	0.05
F	批发和零售业	45,335.50	0.08
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	213,318.00	0.37
J	金融业	165,393.70	0.29
K	房地产业	121,537.05	0.21
L	租赁和商务服务业	33,482.50	0.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	33,349.32	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	13,242.40	0.02
R	文化、体育和娱乐业	43,685.40	0.08
S	综合	8,220.00	0.01
	合计	1,891,249.80	3.29

### 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	000651	格力电器	2,400	52,968.00	0.09
2	000002	万科A	2,900	52,809.00	0.09
3	000982	中银绒业	6,800	41,004.00	0.07
4	000858	五粮液	1,200	39,036.00	0.07

5	000333	美的集团	1,450	34,394.00	0.06
6	000001	平安银行	3,460	30,102.00	0.05
7	000423	东阿阿胶	500	26,415.00	0.05
8	000725	京东方 A	11,000	25,410.00	0.04
9	000776	广发证券	1,300	21,788.00	0.04
10	002024	苏宁云商	2,000	21,720.00	0.04
11	300104	乐视网	400	21,164.00	0.04
12	002450	康得新	1,200	20,520.00	0.04
13	000728	国元证券	1,200	20,064.00	0.03
14	300059	东方财富	880	19,536.00	0.03
15	002415	海康威视	900	19,314.00	0.03
16	002594	比亚迪	300	18,303.00	0.03
17	000783	长江证券	1,500	17,400.00	0.03
18	000503	海虹控股	400	16,084.00	0.03
19	002304	洋河股份	200	14,384.00	0.03
20	000063	中兴通讯	1,000	14,340.00	0.02
21	002736	国信证券	800	13,800.00	0.02
22	000625	长安汽车	1,000	13,670.00	0.02
23	300017	网宿科技	200	13,440.00	0.02
24	000100	TCL 集团	4,000	13,160.00	0.02
25	002230	科大讯飞	400	13,140.00	0.02
26	000538	云南白药	200	12,860.00	0.02
27	000166	申万宏源	1,500	12,615.00	0.02
28	001979	招商蛇口	861	12,269.25	0.02
29	002466	天齐锂业	280	11,953.20	0.02
30	000568	泸州老窖	400	11,880.00	0.02
31	002142	宁波银行	800	11,824.00	0.02
32	002456	欧菲光	400	11,800.00	0.02
33	002241	歌尔股份	400	11,472.00	0.02
34	002252	上海莱士	300	11,304.00	0.02
35	002465	海格通信	900	11,196.00	0.02
36	300024	机器人	440	11,171.60	0.02
37	000402	金融街	1,100	10,692.00	0.02
38	002202	金风科技	700	10,591.00	0.02
39	002673	西部证券	400	10,344.00	0.02
40	000623	吉林敖东	400	9,980.00	0.02
41	000768	中航飞机	500	9,845.00	0.02
42	002405	四维图新	400	9,840.00	0.02
43	000069	华侨城 A	1,500	9,600.00	0.02

44	300070	碧水源	639	9,508.32	0.02
45	300027	华谊兄弟	700	9,478.00	0.02
46	000826	启迪桑德	300	9,165.00	0.02
47	002008	大族激光	400	9,136.00	0.02
48	000157	中联重科	2,200	9,086.00	0.02
49	002049	紫光国芯	200	8,790.00	0.02
50	002340	格林美	1,000	8,770.00	0.02
51	002030	达安基因	310	8,618.00	0.01
52	002183	怡亚通	600	8,592.00	0.01
53	000413	东旭光电	1,000	8,590.00	0.01
54	000839	中信国安	400	8,524.00	0.01
55	000895	双汇发展	400	8,352.00	0.01
56	002500	山西证券	500	8,280.00	0.01
57	000917	电广传媒	500	8,265.00	0.01
58	000009	中国宝安	600	8,220.00	0.01
59	300033	同花顺	100	8,145.00	0.01
60	000686	东北证券	620	8,004.20	0.01
61	300498	温氏股份	220	7,968.40	0.01
62	000793	华闻传媒	800	7,904.00	0.01
63	002236	大华股份	600	7,860.00	0.01
63	002475	立讯精密	400	7,860.00	0.01
64	000748	长城信息	400	7,848.00	0.01
65	000338	潍柴动力	1,000	7,810.00	0.01
66	000559	万向钱潮	500	7,800.00	0.01
67	300168	万达信息	300	7,797.00	0.01
68	300124	汇川技术	400	7,760.00	0.01
69	002439	启明星辰	300	7,749.00	0.01
70	000876	新希望	900	7,488.00	0.01
71	300144	宋城演艺	300	7,473.00	0.01
72	000630	铜陵有色	2,900	7,366.00	0.01
73	300015	爱尔眼科	200	7,306.00	0.01
74	300003	乐普医疗	400	7,296.00	0.01
75	000977	浪潮信息	300	7,035.00	0.01
76	000750	国海证券	950	7,020.50	0.01
77	300253	卫宁健康	280	6,916.00	0.01
78	002007	华兰生物	220	6,908.00	0.01
79	300072	三聚环保	249	6,882.36	0.01
80	000540	中天城投	1,100	6,853.00	0.01
81	002385	大北农	850	6,851.00	0.01

82	000963	华东医药	100	6,740.00	0.01
83	000887	中鼎股份	300	6,633.00	0.01
84	002152	广电运通	400	6,576.00	0.01
85	002081	金螳螂	650	6,513.00	0.01
86	002400	省广股份	450	6,358.50	0.01
87	002001	新和成	300	6,339.00	0.01
88	000792	盐湖股份	300	6,330.00	0.01
89	300315	掌趣科技	600	6,294.00	0.01
90	000050	深天马 A	300	6,261.00	0.01
91	000060	中金岭南	600	6,258.00	0.01
92	000547	航天发展	400	6,144.00	0.01
93	000425	徐工机械	2,000	6,120.00	0.01
94	000938	紫光股份	100	6,088.00	0.01
95	000061	农产品	500	6,080.00	0.01
96	000581	威孚高科	300	6,048.00	0.01
97	002038	双鹭药业	200	6,036.00	0.01
98	300032	金龙机电	300	6,030.00	0.01
99	000988	华工科技	300	6,015.00	0.01
100	000997	新大陆	300	6,012.00	0.01
101	002292	奥飞娱乐	200	5,990.00	0.01
102	300088	长信科技	400	5,948.00	0.01
103	002276	万马股份	300	5,943.00	0.01
104	300077	国民技术	300	5,940.00	0.01
105	300244	迪安诊断	180	5,936.40	0.01
106	002280	联络互动	300	5,913.00	0.01
107	300058	蓝色光标	600	5,826.00	0.01
108	000709	河钢股份	2,100	5,817.00	0.01
109	000970	中科三环	400	5,804.00	0.01
110	002129	中环股份	700	5,803.00	0.01
111	002353	杰瑞股份	300	5,784.00	0.01
112	000012	南玻 A	500	5,730.00	0.01
113	000983	西山煤电	700	5,705.00	0.01
114	000998	隆平高科	300	5,694.00	0.01
115	000039	中集集团	400	5,668.00	0.01
116	300166	东方国信	200	5,646.00	0.01
117	002168	深圳惠程	400	5,632.00	0.01
118	002657	中科金财	100	5,494.00	0.01
119	002701	奥瑞金	620	5,474.60	0.01
120	300055	万邦达	300	5,463.00	0.01

121	002294	信立泰	200	5,440.00	0.01
122	002138	顺络电子	300	5,439.00	0.01
123	000511	*ST 烯碳	600	5,352.00	0.01
124	002299	圣农发展	206	5,335.40	0.01
125	000661	长春高新	50	5,334.00	0.01
126	000738	中航动控	200	5,280.00	0.01
127	000629	*ST 钒钛	2,200	5,258.00	0.01
128	000078	海王生物	700	5,201.00	0.01
129	002491	通鼎互联	300	5,118.00	0.01
130	002573	清新环境	300	5,076.00	0.01
131	000046	泛海控股	500	5,055.00	0.01
132	000410	沈阳机床	300	5,034.00	0.01
133	000656	金科股份	1,300	4,966.00	0.01
134	002104	恒宝股份	300	4,932.00	0.01
135	300274	阳光电源	200	4,880.00	0.01
136	000999	华润三九	200	4,844.00	0.01
137	002266	浙富控股	900	4,815.00	0.01
138	002310	东方园林	200	4,784.00	0.01
139	000671	阳光城	800	4,752.00	0.01
140	002311	海大集团	300	4,731.00	0.01
141	000777	中核科技	200	4,712.00	0.01
142	300291	华录百纳	200	4,706.00	0.01
143	000778	新兴铸管	1,000	4,640.00	0.01
144	000400	许继电气	300	4,632.00	0.01
145	000960	锡业股份	400	4,624.00	0.01
145	300251	光线传媒	400	4,624.00	0.01
146	002467	二六三	300	4,623.00	0.01
146	002422	科伦药业	300	4,623.00	0.01
147	002048	宁波华翔	200	4,574.00	0.01
148	000697	炼石有色	200	4,570.00	0.01
149	002004	华邦健康	500	4,565.00	0.01
150	300170	汉得信息	300	4,554.00	0.01
151	002161	远望谷	300	4,467.00	0.01
152	000021	深科技	400	4,404.00	0.01
153	002625	龙生股份	100	4,398.00	0.01
154	000930	中粮生化	400	4,392.00	0.01
155	001696	宗申动力	400	4,368.00	0.01
156	000566	海南海药	400	4,364.00	0.01
157	000800	一汽轿车	400	4,352.00	0.01

158	300001	特锐德	200	4,338.00	0.01
159	002179	中航光电	100	4,332.00	0.01
160	002051	中工国际	220	4,327.40	0.01
161	002501	利源精制	400	4,320.00	0.01
162	300267	尔康制药	300	4,296.00	0.01
162	002250	联化科技	300	4,296.00	0.01
163	002410	广联达	300	4,290.00	0.01
164	300079	数码视讯	500	4,285.00	0.01
165	002022	科华生物	200	4,262.00	0.01
166	300002	神州泰岳	400	4,256.00	0.01
167	300043	互动娱乐	300	4,251.00	0.01
168	000598	兴蓉环境	800	4,224.00	0.01
169	002273	水晶光电	150	4,198.50	0.01
170	000883	湖北能源	900	4,167.00	0.01
171	000712	锦龙股份	200	4,152.00	0.01
172	002261	拓维信息	300	4,149.00	0.01
173	300115	长盈精密	200	4,120.00	0.01
174	000979	中弘股份	1,500	4,110.00	0.01
175	000878	云南铜业	400	4,072.00	0.01
176	300199	翰宇药业	200	4,070.00	0.01
177	000690	宝新能源	600	4,068.00	0.01
178	300146	汤臣倍健	300	4,062.00	0.01
179	002470	金正大	500	4,025.00	0.01
180	000901	航天科技	100	4,015.00	0.01
181	000829	天音控股	300	4,005.00	0.01
182	002191	劲嘉股份	343	3,975.37	0.01
183	002074	国轩高科	100	3,947.00	0.01
184	002396	星网锐捷	200	3,940.00	0.01
185	000732	泰禾集团	200	3,888.00	0.01
186	300085	银之杰	130	3,887.00	0.01
187	000758	中色股份	500	3,875.00	0.01
188	000851	高鸿股份	300	3,867.00	0.01
189	000627	天茂集团	500	3,865.00	0.01
190	002570	贝因美	300	3,837.00	0.01
191	300273	和佳股份	200	3,830.00	0.01
192	000066	长城电脑	300	3,825.00	0.01
193	000516	国际医学	650	3,802.50	0.01
194	002018	华信国际	400	3,800.00	0.01
195	000729	燕京啤酒	500	3,795.00	0.01

196	002312	三泰控股	200	3,790.00	0.01
197	002474	榕基软件	200	3,780.00	0.01
198	000031	中粮地产	400	3,772.00	0.01
199	002522	浙江众成	200	3,750.00	0.01
200	000156	华数传媒	200	3,710.00	0.01
201	002390	信邦制药	400	3,696.00	0.01
202	000786	北新建材	400	3,632.00	0.01
203	002073	软控股份	300	3,615.00	0.01
204	002477	雏鹰农牧	600	3,582.00	0.01
205	000939	凯迪生态	400	3,580.00	0.01
206	000667	美好集团	1,000	3,570.00	0.01
207	002190	成飞集成	100	3,544.00	0.01
208	002437	誉衡药业	400	3,480.00	0.01
209	300026	红日药业	200	3,478.00	0.01
210	002665	首航节能	440	3,471.60	0.01
211	002424	贵州百灵	200	3,440.00	0.01
212	002428	云南锗业	200	3,436.00	0.01
213	300133	华策影视	220	3,425.40	0.01
214	002375	亚厦股份	300	3,390.00	0.01
214	000592	平潭发展	500	3,390.00	0.01
215	002011	盾安环境	300	3,384.00	0.01
215	002092	中泰化学	400	3,384.00	0.01
216	002681	奋达科技	200	3,376.00	0.01
217	002013	中航机电	250	3,370.00	0.01
218	002146	荣盛发展	500	3,360.00	0.01
219	002185	华天科技	260	3,309.80	0.01
220	300257	开山股份	200	3,304.00	0.01
221	000401	冀东水泥	300	3,270.00	0.01
222	002563	森马服饰	300	3,249.00	0.01
223	002130	沃尔核材	200	3,216.00	0.01
224	000027	深圳能源	500	3,190.00	0.01
225	002223	鱼跃医疗	100	3,172.00	0.01
226	002489	浙江永强	400	3,168.00	0.01
227	300216	千山药机	100	3,163.00	0.01
228	000825	太钢不锈	1,000	3,160.00	0.01
229	000685	中山公用	300	3,114.00	0.01
230	002063	远光软件	200	3,090.00	0.01
231	002055	得润电子	100	3,062.00	0.01
232	000975	银泰资源	200	3,000.00	0.01

233	300134	大富科技	100	2,996.00	0.01
234	300212	易华录	100	2,977.00	0.01
235	002440	闰土股份	200	2,970.00	0.01
236	000816	智慧农业	500	2,955.00	0.01
237	000006	深振业 A	400	2,948.00	0.01
238	300147	香雪制药	200	2,946.00	0.01
239	002431	棕榈股份	250	2,875.00	0.00
240	000543	皖能电力	400	2,856.00	0.00
241	000875	吉电股份	500	2,805.00	0.00
242	002399	海普瑞	160	2,793.60	0.00
243	000158	常山股份	200	2,778.00	0.00
244	000062	深圳华强	100	2,700.00	0.00
245	000937	冀中能源	500	2,660.00	0.00
246	000898	鞍钢股份	670	2,566.10	0.00
247	002429	兆驰股份	300	2,514.00	0.00
248	002285	世联行	320	2,492.80	0.00
249	002195	二三四五	200	2,458.00	0.00
250	300202	聚龙股份	100	2,421.00	0.00
251	000681	视觉中国	100	2,365.00	0.00
252	000961	中南建设	400	2,244.00	0.00
253	300052	中青宝	100	2,203.00	0.00
254	002568	百润股份	100	2,200.00	0.00
255	002498	汉缆股份	500	2,170.00	0.00
256	000539	粤电力 A	400	2,008.00	0.00
257	000861	海印股份	400	1,976.00	0.00
258	002344	海宁皮城	200	1,950.00	0.00
259	002368	太极股份	50	1,776.50	0.00
260	002642	荣之联	50	1,315.50	0.00
261	000693	ST 华泽	100	1,250.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	000001	平安银行	184,577.00	0.27
2	000333	美的集团	168,194.00	0.25

3	000858	五 粮 液	143,461.00	0.21
4	000725	京东方 A	140,152.00	0.21
5	000776	广发证券	138,951.00	0.21
6	002304	洋河股份	127,751.00	0.19
7	002024	苏宁云商	126,870.00	0.19
8	002415	海康威视	116,841.00	0.17
9	300059	东方财富	110,062.00	0.16
10	002594	比亚迪	97,683.00	0.14
11	000783	长江证券	97,408.00	0.14
12	000423	东阿阿胶	88,155.00	0.13
13	000100	TCL 集团	85,310.00	0.13
14	002736	国信证券	83,968.00	0.12
15	002466	天齐锂业	83,750.00	0.12
16	000166	申万宏源	79,775.00	0.12
17	001979	招商蛇口	76,342.00	0.11
18	002450	康得新	76,029.00	0.11
19	300003	乐普医疗	72,810.00	0.11
20	002252	上海莱士	72,094.00	0.11

注：买入金额按买卖成交金额填列，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	000001	平安银行	158,615.00	0.24
2	000333	美的集团	140,598.00	0.21
3	000776	广发证券	123,169.00	0.18
4	000725	京东方 A	118,212.00	0.18
5	000858	五 粮 液	112,781.00	0.17
6	000651	格力电器	107,526.00	0.16
7	002024	苏宁云商	105,848.00	0.16
8	002304	洋河股份	102,035.00	0.15
9	300059	东方财富	96,184.00	0.14
10	000839	中信国安	95,358.00	0.14
11	002415	海康威视	95,131.00	0.14
12	000783	长江证券	90,276.00	0.13
13	002450	康得新	83,022.00	0.12

14	002594	比亚迪	80,896.00	0.12
15	000100	TCL 集团	71,209.00	0.11
16	002736	国信证券	71,198.00	0.11
17	000166	申万宏源	70,687.00	0.10
18	002673	西部证券	67,312.00	0.10
19	000661	长春高新	66,097.00	0.10
20	000423	东阿阿胶	65,772.00	0.10

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	9,888,758.35
卖出股票收入（成交）总额	8,381,117.46

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	200.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	200.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127003	海印转债	2	200.00	0.00

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	深 300ETF	股票型	交易型开放式	汇添富基金管理股份有限公司	52,692,787.83	91.61

## 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

### 7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.12.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无国债期货持仓。

### 7.12.3 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。

## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1

本基金投资前十名证券中的广发证券（000776）于 2015 年 9 月 12 日公告收到《中国证券监

督管理委员会行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]71 号）。中国证券监督管理委员会拟对广发证券涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案做出行政处罚。我司经过研究评估，认为此事件对广发证券经营业绩未产生重大的实质影响，对其投资价值未产生实质影响。本基金持有该股经过合理的投资决策授权审批，符合指数基金投资管理规定。

### 7.13.2

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。

### 7.13.3 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	7,171.83
2	应收证券清算款	258,818.08
3	应收股利	-
4	应收利息	589.72
5	应收申购款	80,740.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	347,320.01

### 7.13.4 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。

### 7.13.5 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	000651	格力电器	52,968.00	0.09	重大事项停牌
2	000002	万科A	52,809.00	0.09	重大资产重组停牌

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,013	10,727.77	134,536.51	0.31%	42,916,008.59	99.69%

### 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	6,346.58	0.01%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2011 年 9 月 28 日) 基金份额总额	336,005,348.19
本报告期期初基金份额总额	42,337,461.72
本报告期基金总申购份额	21,908,733.68
减:本报告期基金总赎回份额	21,195,650.30
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	43,050,545.10

注：表内“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	
东方证券	2	18,269,875.81	100.00%	16,643.10	100.00%	-

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例

				例				
东方证券	547.50	100.00%	-	-	-	-	-125,874.50	100.00%

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：

以上 2 个交易单元未与其他基金共用。本基金本报告期末新增或退租交易单元。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 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 2016 年 1 月 7 日指数熔断后调	管理人网站	2016 年 1 月 7 日

	整旗下部分基金申购与赎回开放时间的公告		
5	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(海格通信、乐视网)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 1 月 12 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告(万科 A、广誉远、华星创业、*ST 京蓝)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 1 月 14 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 年 1 月 20 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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、格力电器)	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
15	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
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(四维图新、佳都科技)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 3 月 19 日

17	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东亚银行（中国）有限公司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 3 月 28 日
18	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
19	汇添富基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告（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
20	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（启迪桑德）	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2016 年 4 月 12 日
21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加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
22	汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接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 年 4 月 29 日
23	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中正达广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 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
25	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 5 月 3 日
26	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在广发银行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 年 5 月 9 日
27	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
28	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 年 5 月 12 日
29	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加民生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 5 月 13 日
30	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加和耕传承为	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管	2016 年 5 月 17 日

	销售机构的公告	理人网站	
31	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
32	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
33	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
34	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
35	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
36	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

## § 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深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
- 2、《汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3、《汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接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