

# 汇添富恒生指数分级证券投资基金 2016 年 年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
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 .....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	17
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	17
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 .....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	17
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告的基本内容.....	17
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表 .....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注 .....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	48

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	49
8.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	49
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	49
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	57
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	59
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	59
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	59
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细 .....	59
8.10 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 .....	59
8.11 投资组合报告附注 .....	59
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	63
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
11.2 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 .....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	66
11.4 基金投资策略的改变 .....	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	66
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
11.8 其他重大事件 .....	68
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>73</b>
12.1 备查文件目录 .....	73
12.2 存放地点 .....	73
12.3 查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富恒生指数分级证券投资基金		
基金简称	汇添富恒生指数分级（QDII）		
场内简称	添富恒生		
基金主代码	164705		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 03 月 06 日		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,454,060,153.39 份		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2014 年 04 月 11 日		
下属分级基金的基金简称	恒生 A	恒生 B	添富恒生
下属分级基金的交易代码	150169	150170	164705
报告期末下属分级基金的份 额总额	596,645,149.00 份	596,645,149.00 份	260,769,855.39 份

注：-

### 2.2 基金产品说明

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

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	林葛
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大厦 21 层	北京复兴门内大街 28 号凯晨世 贸中心东座 9 层
邮政编码		200120	100031
法定代表人		李文	周慕冰

注：-

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

注：本基金无境外投资顾问。

### 2.5 信息披露方式

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

### 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2016 年	2015 年	2014 年 03 月 06 日(基金成立日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-1,140,718.47	-585,734,239.67	14,038,764.12
本期利润	138,595,014.42	-750,300,709.18	15,246,661.54
加权平均基金份额本期利润	0.0891	-0.3026	0.0551
本期加权平均净值利润率	9.54%	-28.66%	5.41%
本期基金份额净值增长率	7.64%	-7.15%	6.20%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	59,960,430.66	-54,340,172.08	10,101,509.67
期末可供分配基金份额利润	0.0412	-0.0347	0.0619
期末基金资产净值	1,460,855,379.05	1,508,911,118.96	173,188,058.42
期末基金份额净值	1.005	0.963	1.062
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	6.15%	-1.39%	6.20%

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

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

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

4、本基金的《基金合同》生效日为 2014 年 3 月 6 日，至本报告期末未满三年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2016 年 12 月 31 日数据，特此说明。

### 3.2 基金净值表现

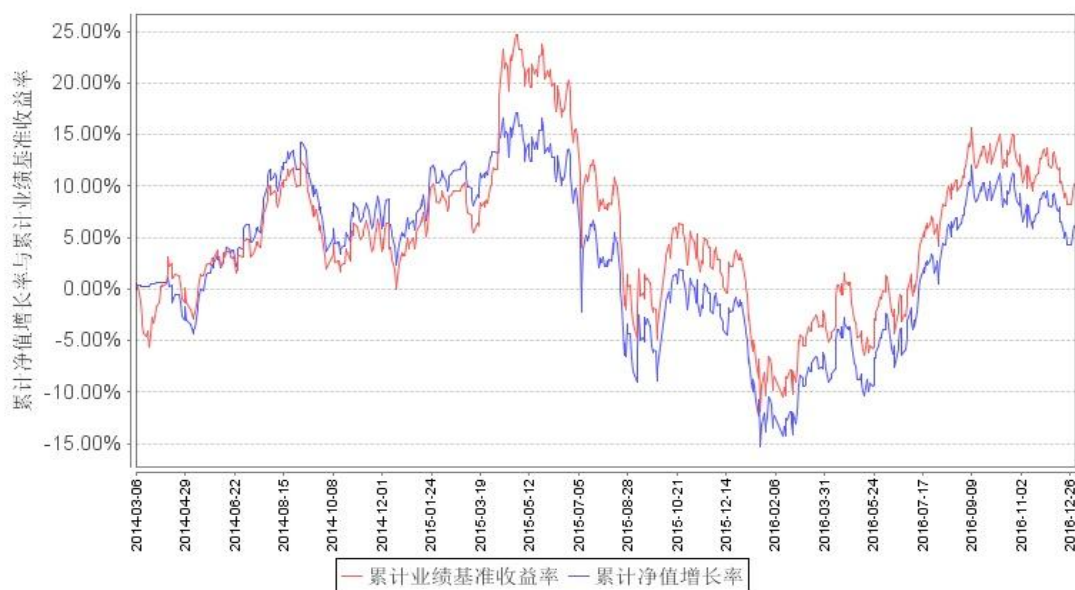
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.24%	0.86%	-1.78%	0.86%	-0.46%	0.00%
过去六个月	9.48%	0.89%	10.20%	0.89%	-0.72%	0.00%
过去一年	7.64%	1.11%	6.92%	1.12%	0.72%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今	6.15%	1.09%	10.18%	1.11%	-4.03%	-0.02%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2014 年 3 月 6 日，至本报告期末未满三年。

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

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

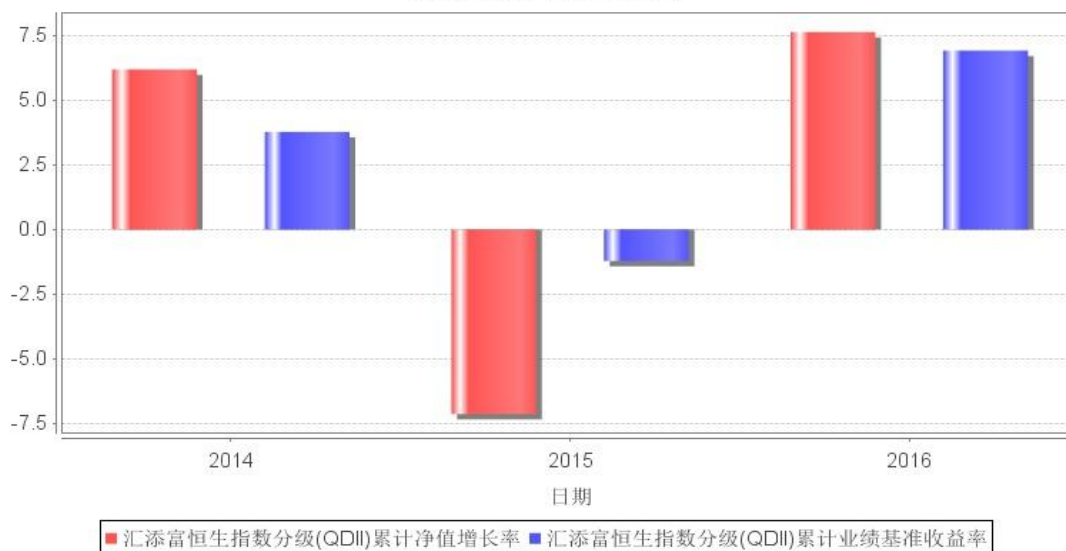




注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2010年6月25日）起6个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富恒生指数分级(QDII)自基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金的《基金合同》生效日为2014年3月6日，至本报告期末满五年。2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金2014年、2015年、2016年均未进行利润分配。

## § 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成立于2005年2月，总部设在上海陆家嘴，公司旗下设立了北京、南方、上海虹桥机场及成都四个分公司，以及两个子公司—汇添富资产管理(香港)有限公司(China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited)和汇添富资本管理有限公司。

汇添富是中国第一批获得QDII业务资格、专户业务资格、设立海外子公司并且获得RQFII业务资格的基金公司，同时是全国社会保障基金投资管理人，基本养老保险基金委托投资管理人。截至目前，汇添富已经构建起公募、专户、社保基金、养老金、国际业务等投融资业务以及互联

网金融业务协同发展的统一的资产管理服务平台。

汇添富始终坚持“以企业基本分析为立足点,挑选高质量的证券,把握市场脉络,做中长期投资布局,以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益”这一长期价值投资理念,并在投资研究中坚定地贯彻和执行。2016 年,汇添富保持了优秀的投资业绩:截至 2016 年年底,汇添富基金旗下权益主动管理型基金过去 5 年平均收益率 139%,在大型基金公司中持续排名第一(数据来源:银河证券基金研究中心)。优秀的投资业绩获得了行业高度认可。2016 年,公司先后获得“年度十大明星基金公司”、“五年持续回报明星基金公司”、“金基金·TOP 公司”等多项荣誉;汇添富民营活力、汇添富价值精选、汇添富全额宝获得“金牛基金”大奖。

2016 年,汇添富基金新发 16 只基金,包括 2 只股票型基金,5 只指数基金,3 只债券型基金,4 只保本基金,以及 2 只混合型基金。其中,上海国企 ETF 首募规模达 152 亿元,位居今年所有权益类产品发行规模首位。全年,公司公募基金产品达到 75 只,涵盖权益、固定收益、混合、灵活配置、指数、货币基金等风险程度和预期收益从高到低的各类产品,为投资者提供更加全面的资产配置选择。

2016 年,汇添富基金在规范电子商务运作的基础上,陆续完成安全中心体系、快捷支付渠道及新版手机 APP 建设,加强优化客户体验,提升客户服务能力。公司电子商务平台保有规模排名行业前列。

2016 年,汇添富基金稳步推行大机构战略,截至年底,公司机构理财总部保有规模达 2250 亿元。12 月,公司成功竞获基本养老保险基金管理人资格,未来将为做好做大养老金投资业务而努力。

2016 年,公司积极开展渠道销售和培训工作。优秀的投资业绩、专业的投顾服务以及良好的渠道维护口碑带来了汇添富品牌在渠道影响力的显著提升。在传统大中型银行和券商渠道的基础上,公司进一步拓展了中小型银行及券商渠道,助力新基金发行。2016 年,公司所有新发基金规模在同期同类新基金中排名均位居前列。公司大力开展“汇定投·汇添富”系列定投推广活动,营销培训活动拓展到银行和券商的网点、营业部,全力打造汇添富定投品牌。

2016 年,汇添富基金继续提升客户服务能力,全方位优化客户服务体系。公司通过完善大客户平台建设,搭建了囊括投顾式服务、理财基金、高端客户、现金宝的全新客服体系,为公司各项销售业务提供全方位支持。

2016 年,香港子公司的国际业务取得较大进展。香港子公司顺利成为韩国退休教师基金 KTCU 选聘的 A 股投资管理人,并获得台湾第一金证券投资信托股份有限公司委任,成为其两只公募基金

的投资顾问。

2016 年，公司持续加强公益事业建设，践行企业社会责任，公益活动影响力得到进一步提升。1 月，公司开展第二期“添富之爱”员工与贫困地区学生一对一结对帮扶认领活动，160 名乡村学子与汇添富员工完成结对。3 月，南京山地马拉松通过报名筹款为“河流·孩子”项目筹得善款近 7 万元。5 月，公司员工参加“一个鸡蛋的暴走”筹得善款 12 万元。6 月，公司首次开展海外学子支教活动，组织优秀中国留学生赴宁夏泾源县兰大庄添富小学，开展为期 1 周的公益支教活动。志愿者们充分借鉴海外教学的授课方式，帮助乡村小学生打开视野。8 月，南方多省遭遇严重洪涝灾害，公司员工自发地发起赈灾捐款，成功募集 20 余万元善款，全部用于为受灾地区学校捐赠图书、教学和生活用品。10 月，上海国际马拉松赛的“全马完赛公益捐赠活动”累计筹集 17 万善款。

2017 年是实施“十三五”规划的重要一年，资本市场改革进一步深化，财富管理行业在混业竞争、互联网金融、两地基金互认的多重推动下将面临更大的挑战与机遇。汇添富基金将始终坚信长期的力量，拥抱变革、奋勇拼搏、砥砺前行，为筑造中国梦添砖加瓦，为成为中国最优秀的资产管理公司的梦想努力奋斗！

#### 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	2014-03-06	-	9 年	国籍：中国，学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士，相关业务资格：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

	<p>港优势混合基金的基金经理、汇添富中证环境治理指数（LOF）基金的基金经理。</p>			<p>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 2016 年 7 月 13 日任汇添富香港优势混</p>
--	--	--	--	--

					合基金的基金经理，2016年12月29日至今任汇添富中证环境治理指数（LOF）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。

#### 4.1.3 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

#### 4.2 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 公平交易制度和控制方法

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》，本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究环节，公司建立了统一的投研平台信息管理系统，公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时，通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机

会。(2) 在投资环节, 公司针对基金、专户、社保、境外投资分别设立了投资决策委员会, 各委员会根据各自议事规则分别召开会议, 在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略, 独立制定资产配置计划和组合调整方案, 并严格执行交易决策规则, 以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。(3) 在交易环节, 公司实行集中交易, 所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式, 按照“时间优先、价格优先、比例分配”的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理, 严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配, 确保交易的公平性。(4) 在交易监控环节, 公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式, 对投资交易全过程实施监督, 对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。(5) 在报告分析方面, 公司按季度和年度编制公平交易分析报告, 并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。同时, 投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

#### 4.3.2 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。报告期内, 本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度, 进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、清算, 以及稽核监察等相关部门组成, 各部门各司其职, 对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控, 确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内, 公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析, 并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下(日内、3日、5日)同向交易的样本, 根据95%置信区间下差价率的T检验显著程度、差价率均值是否小于1%、同向交易占优比等方面进行综合分析, 未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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10次, 均是因为投资策略原因, 并经过公司内部风控审核。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

回顾 16 年，香港市场全年行情震荡向上，成为亚太市场表现最为强劲的大类资产之一。随着香港市场的投资价值不断显现，海内外投资者对港股的关注日益提升。我们认为，香港市场本轮上涨的驱动因素主要来自于以下两个方面：首先，经历了 2015 年市场的下跌，香港市场整体估值已经非常便宜，风险也得到了充分释放，其投资价值在全球范围内较为突出；其次，深港通稳步推进给予市场情绪较大催化，市场预期在未来两地互联互通的新环境下，香港市场将大大受到青睐。报告期内，本基金按照基金合同，按照完全复制法进行恒生指数成份股指数化投资，严控基金跟踪误差，以期为投资者带来与恒生指数一致的收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金净值上涨 7.64%，业绩比较基准上涨 6.92%，超额收益为 0.72%。

## 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 2017 年，深港通将继续成为市场情绪的驱动力，而香港市场较为合理的估值水平将成为长期市场稳定的基础。从估值水平来看，当前恒生指数整体市盈率等财务指标依然处于历史相对低位。而在以机构主导的香港市场，当估值趋于合理时市场会给予理性的反馈，2016 年下半年以来，尤其是 2017 年年初市场的强势表现部分印证了我们的看法。我们认为，若市场非理性下行，则股票市场的价值发现作用将起作用，香港市场价格低廉的优质股票具有很强的吸引力。而 2017 年市场的风险点主要有美国总统川普上台引发的不确定性以及美联储加息的进程，我们认为市场对这两点的预期较为充分。从配置角度来看，在全球经济金融形势转为乐观之后，港股依然可以贡献可观的超额收益。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司以维护基金份额持有人利益为宗旨，有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则，认真履行职责，通过常规稽核、专项检查 and 系统监控等方式方法积极开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，促进内部控制和风险管理的不断改进，并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

### （一）完善规章制度，健全内部控制体系

在本报告期内，督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估，并根据各项业务特点、业务发展实际，建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程，进一步明确了内部控制和风险管理责任，公

司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善，为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

#### （二）加强稽核监察，确保基金运作和公司经营合法合规

本报告期内，督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察，包括对基金投资交易行为、投资指标的监控，对投资组合的风险度量、评估和建议，对基金信息披露的审核、监督，对基金销售、营销的稽核、控制，对基金营运、技术系统的稽核、评估，切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

#### （三）强化培训教育，提高全员合规意识

本报告期内，督察长和稽核监察部门积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险意识、合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强内部控制和风险管理，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、产品创新部、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。报告期内，本基金依据签署的《中债收益率



曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	汇添富恒生指数分级证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的汇添富恒生指数分级证券投资基金财务报表, 包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人汇添富基金管理股份有限公司的责任。这种责任包括:(1) 按照企业会计准则的规定编制财务报表, 并使其实现公允反映;(2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为, 上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制, 公允反映了汇添富恒生指数分级证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	陈露	陈军
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2017 年 3 月 28 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 汇添富恒生指数分级证券投资基金

报告截止日: 2016 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	213,415,655.46	191,066,769.32
结算备付金		131,724,540.75	107,805,656.06
存出保证金		16,512,654.60	18,630,132.75
交易性金融资产	7.4.7.2	1,111,861,005.54	1,191,249,116.44

其中：股票投资		1,111,861,005.54	1,191,249,116.44
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	18,031.92	6,594.61
应收股利		106,691.61	57,673.04
应收申购款		465,801.67	2,629,686.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,474,104,381.55	1,511,445,628.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
<b>益</b>		<b>2016年12月31日</b>	<b>2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		112.43	134.67
应付赎回款		10,112,640.75	215,144.14
应付管理人报酬		1,584,947.80	1,506,803.28
应付托管费		330,197.43	313,917.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	255,488.15	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	965,615.94	498,510.24
负债合计		13,249,002.50	2,534,509.67
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,400,894,948.39	1,563,251,291.04
未分配利润	7.4.7.10	59,960,430.66	-54,340,172.08
所有者权益合计		1,460,855,379.05	1,508,911,118.96
负债和所有者权益总计		1,474,104,381.55	1,511,445,628.63

注：(1) 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.005 元，基金份额总额 1,454,060,153.39

份，其中下属添富恒生份额净值 1.005 元，份额总额 260,769,855.39 份；下属恒生 A 份额净值 1.044 元，份额总额 596,645,149.00 份；下属恒生 B 份额净值 0.966 元，份额总额 596,645,149.00 份。（2）报表附注为财务报表的组成部分。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日 至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		164,442,096.56	-699,268,015.48
1. 利息收入		1,066,015.13	7,214,972.98
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,066,015.13	7,214,972.98
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		1,176,173.83	-561,390,346.58
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-58,841,264.07	-187,784,160.89
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	25,005,944.35	-431,330,879.70
股利收益	7.4.7.17	35,011,493.55	57,724,694.01
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	139,735,732.89	-164,566,469.51
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		20,308,310.47	11,152,034.24
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.19	2,155,864.24	8,321,793.39

号填列)			
<b>减：二、费用</b>		25,847,082.14	51,032,693.70
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	17,389,960.83	30,747,404.51
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,622,908.38	6,405,709.28
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	3,791,660.06	12,169,815.48
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回 购金融资产支 出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	1,042,552.87	1,709,764.43
<b>三、利润总额 (亏损总额以 “-”号填列)</b>		138,595,014.42	-750,300,709.18

注：报表附注为财务报表的组成部分。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权 益（基金净值）	1,563,251,291.04	-54,340,172.08	1,508,911,118.96
二、本期经营活动 产生的基金净值 变动数（本期净利 润）	-	138,595,014.42	138,595,014.42
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）	-162,356,342.65	-24,294,411.68	-186,650,754.33
其中：1. 基金申购 款	12,590,498,816.71	-126,968,622.72	12,463,530,193.99
2. 基金赎 回款	-12,752,855,159.36	102,674,211.04	-12,650,180,948.32
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）	1,400,894,948.39	59,960,430.66	1,460,855,379.05
项目	上年度可比期间		
	2015年01月01日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、上年初所有者权益（基金净值）	163,086,548.73	10,101,509.69	173,188,058.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-750,300,709.18	-750,300,709.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,400,164,742.31	685,859,027.41	2,086,023,769.72
其中：1. 基金申购款	7,870,400,161.16	880,152,531.99	8,750,552,693.15
2. 基金赎回款	-6,470,235,418.85	-194,293,504.58	-6,664,528,923.43
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）	1,563,251,291.04	-54,340,172.08	1,508,911,118.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

李骁

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇添富恒生指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1247号文《关于核准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发行募集，基金合

同于 2014 年 3 月 6 日正式生效，首次设立募集规模为 1,270,631,138.98 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司，境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司(The Hong Kong and Shanghai Banking Co., Ltd.)。本基金的份额包括汇添富恒生指数分级证券投资基金之基础份额（简称“添富恒生份额”）、汇添富恒生指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“恒生 A 份额”）与汇添富恒生指数分级证券投资基金之积极收益类份额（简称“恒生 B 份额”）。其中，恒生 A、恒生 B 的基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变。本基金的基础份额为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。恒生 A 份额将具有低风险、收益稳定特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额，类似于债券型基金份额。恒生 B 份额则具有高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额，类似于具有收益杠杆性的股票型基金份额。本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于债券、基金（包括股票基金、债券基金、交易所交易基金等）、金融衍生工具（包括远期合约、互换、期货、期权、权证等）、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的 80%。本基金的业绩比较基准：经人民币汇率调整的恒生指数收益率 $\times 95\%$  + 商业银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和半年度报告》、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。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票投资。本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、存出保证金和各类应收款项等。

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其



他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

#### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未

发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值； (4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20%的年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提；

(3) 基金指数使用费按前一日基金资产净值的 0.04%的年费率计提；

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，场外投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。场内基金份额收益分配方式只能为现金分红；场内基金份额具体收益分配程序等有

关事项遵循深圳证券交易所及登记机构的相关规定；(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(4) 每一基金份额享有同等分配权；(5) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。于估值日，外币货币性项目采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入当期损益。以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额，作为公允价值变动的一部分直接计入当期损益。本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金的基金管理人以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定本基金的经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确

全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税；
- (2) 2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；
- (3) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；
- (4) 基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	213,415,655.46	191,066,769.32
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	213,415,655.46	191,066,769.32

注：本基金于 2016 年 12 月 31 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 137,751,569.43 元（折合人民币 123,220,156.37 元），美元 51.22 元（折合人民币 355.31 元）。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,140,190,711.63	1,111,861,005.54	-28,329,706.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券 交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,140,190,711.63	1,111,861,005.54	-28,329,706.09
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,354,626,035.91	1,191,249,116.44	-163,376,919.47
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,354,626,035.91	1,191,249,116.44	-163,376,919.47

注：-

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	255,387,972.06	4,706,866.89	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	255,387,972.06	4,706,866.89	-	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍	-	-	-	-

生工具				
权益衍生工具	229,428,650.12	18,347.38	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	229,428,650.12	18,347.38	-	-

注：（1）衍生金融资产项下的股指期货投资净额折合人民币 0.00 元。在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益折合人民币 4,706,866.89 元）（2015 年末：人民币 18,347.38 元）之间按抵销后的净额折合人民币 0.00 元；（2）本基金本期末持有恒生指数期货合约（Hang Seng Index Futures）260 张（2015 年末：250 张）；

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	14,741.75	6,594.61
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	3,290.17	-
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	-	-
合计	18,031.92	6,594.61

注：应收结算备付金利息为应收港股通备付金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	255,488.15	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	255,488.15	-

注：本基金上年度末无应付交易费用余额。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	35,950.63	786.55
其他应付款	-	-
应付审计费	50,000.00	50,000.00
应付信息披露费	300,000.00	300,000.00
应付指数使用费	579,665.31	147,723.69
合计	965,615.94	498,510.24

注：-

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年末	1,567,164,608.27	1,563,251,291.04
本期申购	12,590,498,816.71	12,590,498,816.71
本期赎回（以“-”号填列）	-12,752,855,159.36	-12,752,855,159.36
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	49,251,887.77	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,454,060,153.39	1,400,894,948.39

注：-

#### 7.4.7.10 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
上年末	-154,201,935.79	99,861,763.71	-54,340,172.08



本期利润	-1,140,718.47	139,735,732.89	138,595,014.42
本期基金份额交易产生的变动数	9,264,391.86	-33,558,803.54	-24,294,411.68
其中：基金申购款	-6,145,916.50	-120,822,706.22	-126,968,622.72
基金赎回款	15,410,308.36	87,263,902.68	102,674,211.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-146,078,262.40	206,038,693.06	59,960,430.66

注：-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日至2016年12月31日	2015年01月01日至2015年12月31日
活期存款利息收入	979,942.57	6,883,087.91
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	75,986.29	324,603.00
其他	10,086.27	7,282.07
合计	1,066,015.13	7,214,972.98

注：其他为直销申购款和交易保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日至2016年12月31日	2015年01月01日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	912,024,855.69	1,936,210,567.64
减：卖出股票成本总额	970,866,119.76	2,123,994,728.53
买卖股票差价收入	-58,841,264.07	-187,784,160.89

注：-

#### 7.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2016年01月01日至2016年12月31日	2015年01月01日至2015年12月31日
股指期货投资收益	25,005,944.35	-431,330,879.70

注：-

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日至2016年12月31日	2015年01月01日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	35,011,493.55	57,724,694.01
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	35,011,493.55	57,724,694.01

注：-

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日至2016年12月31日	2015年01月01日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	135,047,213.38	-164,584,816.89
——股票投资	135,047,213.38	-164,584,816.89
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	4,688,519.51	18,347.38
合计	139,735,732.89	-164,566,469.51

注：“其他”为股指期货公允价值变动损益。

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日至2016年12月31日	2015年01月01日至2015年12月31日
基金赎回费收入	2,155,864.24	8,321,793.39
合计	2,155,864.24	8,321,793.39

注：-

## 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日至2016年12月31日	2015年01月01日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	3,791,660.06	12,169,815.48
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,791,660.06	12,169,815.48

注：-

## 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日至2016年12月31日	2015年01月01日至2015年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
指数使用费	579,665.31	1,023,137.41
银行汇划费	16,883.85	276,627.02
上市费	60,000.00	60,000.00
其他	36,003.71	-
合计	1,042,552.87	1,709,764.43

注：-

## 7.4.7.22 分部报告

收入	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日至2016年12月31日	2015年01月01日至2015年12月31日
中国大陆	3,216,851.73	-209,578,927.21
中国香港	140,916,934.36	-494,203,241.26
其他	20,308,310.47	4,514,152.99
合计	164,442,096.56	-699,268,015.48

注：截至2016年12月31日止，本基金无非流动资产。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6 税项中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资本管理有限公司	基金管理人施加重大影响的联营企业
上海汇丰银行有限公司（“汇丰银行”）	基金境外托管人
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批的关键管理人员

注：汇添富基金管理股份有限公司 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，汇添富基金管理股份有限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。汇添富基金管理股份有限公司已于 2016 年 8 月 13 日就上述股东变更事项进行公告。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日 至 2015 年 12 月 31 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	1,289,493,154.2 4	0.7728	2,325,074,464.07	0.4559
-	-	-	-	-

注：-

### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

### 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.10.1.6 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01月01日 至 2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例
东方证券股份有限公司	1,289,491.68	71.57%	255,488.15	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年01月01日 至 2015年12月31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	2,325,073.08	41.62%	-	-%

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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日 至 2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年01月01日 至 2015年 12月31日
	当期发生的基金应支付的	17,389,960.83

管理费		
其中：支付销售机构的客户 维护费	559,366.40	570,255.97

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$ 。H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日的基金资产净值。基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 3 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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 01 月 01 日 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的 托管费	3,622,908.38	6,405,709.28

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。基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 3 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、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	
	2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 12 月 31 日	
基金合同生效日 (2014 年 3 月 6 日) 持有的基金份额		-
期初持有的基金份额		-
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	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-

项目	上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日 至 2015 年 12 月 31 日	
	基金合同生效日 (2014 年 3 月 6 日) 持有的基金份额	
期初持有的基金份额		-
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		-
期末持有的基金份额占基金总份额比例		-

注：-

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

份额单位：份

恒生 A				
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
东方证券股份有限公司	1,957,700.00	0.33%	-	-%
恒生 B				
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
东方证券股份有限公司	200,000.00	0.03%	-	-%
添富恒生				

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
-	-	-%	-	-%

注：：东方证券股份有限公司于 2016 年 12 月 7 日买入恒生 A1,960,000 份，于 2016 年 12 月 13 日买入恒生 A1,970,000 份，于 2016 年 12 月 26 日卖出恒生 A1,972,300 份；东方证券股份有限公司分别于 2016 年 9 月 7 日、2016 年 9 月 13 日、2016 年 9 月 30 日、2016 年 11 月 22 日买入恒生 B50,000 份。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 01 月 01 日 至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日 至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	90,195,287.01	974,914.93	27,797,206.79	6,883,087.91
中国农业银行股份有限公司	123,220,368.45	-	163,269,562.53	-

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

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。



#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。此外，基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，本报告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。

##### 7.4.13.4 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。

### 7.4.13.4.1 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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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
<b>资产</b>							
银行存款	213,415,655.46	-	-	-	-	-	213,415,655.46
备付金	131,724,540.75	-	-	-	-	-	131,724,540.75
存出保证金	16,512,654.60	-	-	-	-	-	16,512,654.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,111,861,005.54	1,111,861,005.54
应收股利	-	-	-	-	-	106,691.61	106,691.61
应收利息	-	-	-	-	-	18,031.92	18,031.92
应收申购款	20,824.99	-	-	-	-	444,976.68	465,801.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>361,673,675.80</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,112,430,705.75</b>	<b>1,474,104,381.55</b>
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,112,640.75	10,112,640.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,584,947.80	1,584,947.80
应付托管费	-	-	-	-	-	330,197.43	330,197.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	255,488.15	255,488.15
应付证券清算款	-	-	-	-	-	112.43	112.43
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-	-	965,615.94	965,615.94
负债总计	-	-	-	-	-	13,249,002.50	13,249,002.50
利率敏感度缺口	361,673,675.80	-	-	-	-	-1,099,181,703.25	1,460,855,379.05
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	191,066,769.32	-	-	-	-	-	191,066,769.32
备付金	107,805,656.06	-	-	-	-	-	107,805,656.06
存出保证金	18,630,132.75	-	-	-	-	-	18,630,132.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,191,249,116.44	1,191,249,116.44
应收股利	-	-	-	-	-	57,673.04	57,673.04
应收利息	-	-	-	-	-	6,594.61	6,594.61
应收申购款	14,374.07	-	-	-	-	2,615,312.34	2,629,686.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	317,516,932.20	-	-	-	-	-1,193,928,696.43	1,511,445,628.63
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	215,144.14	215,144.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,506,803.28	1,506,803.28
应付托管费	-	-	-	-	-	313,917.34	313,917.34
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	134.67	134.67
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	498,510.24	498,510.24
负债总计	-	-	-	-	-	2,534,509.67	2,534,509.67

计							
利率敏感缺口	317,516,932.20	-	-	-	-1,191,394,186.76	1,508,911,118.96	

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末及上年度末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	355.31	123,220,156.37	-	123,220,511.68
结算备付金	-	131,724,540.75	-	131,724,540.75
交易性金融资产	-	1,111,861,005.54	-	1,111,861,005.54
应收股利	-	106,691.61	-	106,691.61
应收利息	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
存出保证金	-	16,512,654.60	-	16,512,654.60

资产合计	355.31	1,383,425,048.87	-	1,383,425,404.18
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	355.31	1,383,425,048.87	-	1,383,425,404.18
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	332.60	163,269,364.08	-	163,269,696.68
结算备付金	-	107,805,656.06	-	107,805,656.06
交易性金融资产	-	1,191,249,116.44	-	1,191,249,116.44
应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
存出保证金	-	18,630,132.75	-	18,630,132.75
资产合计	332.60	1,480,954,269.33	-	1,480,954,601.93
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净	332.60	1,480,954,269.33	-	1,480,954,601.93

额				
---	--	--	--	--

注：-

#### 7.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	港币相对人民币升值5%	69,165,917.86	74,047,730.10
	港币相对人民币贬值5%	-69,165,917.86	-74,047,730.10
	美元相对人民币升值5%	17.77	16.63
	美元相对人民币贬值5%	-17.77	-16.63

注：

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

注：本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。另外还可投资于债券、基金、金融衍生工具、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，所面临的最大的市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31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	1,111,861,005.54	76.11	1,191,249,116.44	78.95
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-

交易性金融资产 — 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产 — 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1, 111, 861, 005. 54	76. 11	1, 191, 249, 116. 44	78. 95

注：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的 80%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合的贝塔系数紧密相关；以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	经人民币汇率调整的恒生指数收益率增加 5%	67, 894, 233. 64	71, 081, 790. 74
	经人民币汇率调整的恒生指数收益率减少 5%	-67, 894, 233. 64	-71, 081, 790. 74

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 1, 111, 861, 005. 54 元，无划分为第二层次及第三层次的余额（于 2015 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 1, 191, 267, 463. 82 元，无划分为第二层次及第三层次的余额）。

##### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相

关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	1,111,861,005.54	75.43
	其中：普通股	1,111,861,005.54	75.43
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	345,140,196.21	23.41
8	其他各项资产	17,103,179.80	1.16
9	合计	1,474,104,269.12	100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 514,936,730.36 人民币，占期末净值比



例 35.25%。

## 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
香港	1,111,861,005.54	76.11
合计	1,111,861,005.54	76.11

注：-

## 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
10 能源	205,568,196.21	14.07
20 工业	34,913,861.31	2.39
25 非必需消费品	32,730,979.63	2.24
30 必需消费品	18,215,922.39	1.25
40 金融	544,568,192.75	37.28
45 信息科技	126,851,473.90	8.68
50 电信服务	86,945,352.25	5.95
55 公用事业	62,067,027.10	4.25
合计	1,111,861,005.54	76.11

注：-

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股	5 HK	香港联合交易所	香港	2,130,400.00	118,627,590.47	8.12
2	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	香港	668,900.00	113,504,669.08	7.77

3	CHINA CONSTRUCTION B	建设 银行	939 HK	香港 联合 交易所	香港	17,895,000.00	95,563,321.01	6.54
4	AIA GROUP LTD	友邦 保险	1299 HK	香港 联合 交易所	香港	2,096,200.00	82,034,393.96	5.62
5	CHINA MOBILE LTD	中国 移动	941 HK	香港 联合 交易所	香港	1,068,000.00	78,528,675.09	5.38
6	IND & COMM BK OF CHI	工商 银行	1398 HK	香港 联合 交易所	香港	12,830,000.00	53,366,019.35	3.65
7	BANK OF CHINA LTD-H	中国 银行	3988 HK	香港 联合 交易所	香港	13,815,000.00	42,510,335.43	2.91
8	CHEUNG KONG HOLDINGS	长和	1 HK	香港 联合 交易所	香港	469,848.00	36,942,940.26	2.53
9	HONG KONG EXCHANGES	香港 交易	388 HK	香港	香港	202,300.00	33,151,757.13	2.27

		所		联合交易所				
10	PING AN INSURANCE GR	中国 平安	2318 HK	香港 联合交易所	香港	906,500.00	31,461,884.62	2.15
11	CNOOC LTD	中国 海洋 石油	883 HK	香港 联合交易所	香港	3,106,000.00	26,949,976.18	1.84
12	CHINA LIFE INSURANCE	中国 人寿	2628 HK	香港 联合交易所	香港	1,294,000.00	23,381,417.98	1.60
13	CHINA PETROLEUM & CH	中国 石油 化工 股份	386 HK	香港 联合交易所	香港	4,436,000.00	21,824,254.98	1.49
14	CLP HOLDINGS LTD	中电 控股	2 HK	香港 联合交易所	香港	329,500.00	21,000,299.46	1.44
15	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	长实 地产	1113 HK	香港 联合	香港	468,348.00	19,920,690.65	1.36

				交易所				
16	SUN HUNG KAI PROPERT	新鸿 基地 地产	16 HK	香港 联合 交易 所	香港	227,000.00	19,899,269.46	1.36
17	PETROCHINA CO LTD-H	中国 石油 股份	857 HK	香港 联合 交易 所	香港	3,670,000.00	18,974,882.83	1.30
18	LINK REIT	领汇 房产 基金	823 HK	香港 联合 交易 所	香港	388,000.00	17,492,321.95	1.20
19	HANG SENG BANK LTD	恒生 银行	11 HK	香港 联合 交易 所	香港	133,000.00	17,167,346.47	1.18
20	HONG KONG & CHINA GA	香港 中华 煤气	3 HK	香港 联合 交易 所	香港	1,326,566.00	16,304,248.84	1.12
21	BOC HONG KONG HOLDIN	中银 香港	2388 HK	香港 联合 交易 所	香港	643,500.00	15,973,376.88	1.09

				所				
22	POWER ASSETS HOLDING	电 能 实 业	6 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	241,000.00	14,734,681.79	1.01
23	SANDS CHINA LTD	金 沙 中 国 有 限 公 司	1928 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	421,200.00	12,697,068.53	0.87
24	GALAXY ENTERTAINMENT	银 河 娱 乐	27 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	408,000.00	12,335,650.70	0.84
25	CHINA OVERSEAS LAND	中 国 海 外 发 展	688 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	666,000.00	12,242,532.22	0.84
26	WHARF HOLDINGS LTD	九 龙 仓 集 团	4 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	226,000.00	10,421,309.85	0.71
27	CITIC Pacific Limited	中 信 股 份	267 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	1,012,000.00	10,048,209.73	0.69
28	MTR CORP	港 铁	66 HK	香	香 港	256,500.00	8,649,956.42	0.59

		公司		港 联 合 交 易 所				
29	CHINA UNICOM HONG KO	中国 联通	762 HK	香港 联 合 交 易 所	香港	1,042,000.00	8,416,677.16	0.58
30	AAC TECHNOLOGIES HOL	瑞 声 科 技	2018 HK	香港 联 合 交 易 所	香港	128,000.00	8,066,333.38	0.55
31	CHINA SHENHUA ENERGY	中国 神 华	1088 HK	香港 联 合 交 易 所	香港	591,000.00	7,718,368.98	0.53
32	BANK OF COMMUNICATIO	交 通 银 行	3328 HK	香港 联 合 交 易 所	香港	1,522,000.00	7,637,702.07	0.52
33	CHINA RESOURCES LAND	华 润 置 地	1109 HK	香港 联 合 交 易 所	香港	482,444.00	7,526,249.13	0.52
34	NEW WORLD DEVELOPMEN	新 世 界 发 展	17 HK	香港 联	香港	980,000.00	7,188,282.36	0.49

				合交易所				
35	HENDERSON LAND DEVEL	恒基 地产	12 HK	香港 联合 交易 所	香港	189,375.00	6,987,660.54	0.48
36	HENGAN INTL GROUP CO	恒安 国际	1044 HK	香港 联合 交易 所	香港	126,500.00	6,444,206.58	0.44
37	CHINA MENGNIU DAIRY	蒙牛 乳业	2319 HK	香港 联合 交易 所	香港	477,000.00	6,374,618.17	0.44
38	CHEUNG KONG INFRASTR	长 江 基 建 集 团	1038 HK	香港 联合 交易 所	香港	115,000.00	6,346,995.71	0.43
39	The Bank of East Asia Limited	东 亚 银 行	23 HK	香港 联合 交易 所	香港	233,400.00	6,200,725.43	0.42
40	SWIRE PACIFIC LTD-A	太 古 股 份 公 司 A	19 HK	香港 联合 交	香港	86,500.00	5,729,627.26	0.39

				易所				
41	Sino Land Company Limited	信和置业	83 HK	香港联合交易所	香港	536,000.00	5,571,294.53	0.38
42	WANT WANT CHINA HOLD	中国旺旺	151 HK	香港联合交易所	香港	1,214,000.00	5,397,097.64	0.37
43	LENOVO GROUP LTD	联想集团	992 HK	香港联合交易所	香港	1,256,000.00	5,280,471.44	0.36
44	HANG LUNG PROPERTIES	恒隆地产	101 HK	香港联合交易所	香港	352,000.00	5,176,422.03	0.35
45	BELLE INTERNATIONAL	百丽国际	1880 HK	香港联合交易所	香港	1,173,000.00	4,574,774.60	0.31
46	CHINA MERCHANTS HLDG	招商局国际	144 HK	香港联合交易所	香港	228,000.00	3,923,964.90	0.27



47	CHINA RESOURCES POWE	华润电力	836 HK	香港联合交易所	香港	334,000.00	3,680,801.30	0.25
48	Li and Fung Limited	利丰	494 HK	香港联合交易所	香港	1,024,000.00	3,123,485.80	0.21
49	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆仑能源	135 HK	香港联合交易所	香港	562,000.00	2,915,744.80	0.20
50	CATHAY PACIFIC AIRWA	国泰航空	293 HK	香港联合交易所	香港	205,000.00	1,870,420.41	0.13

注：-

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	HSBC HOLDINGS PLC	5 HK	72,634,905.31	4.81
2	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	63,692,991.69	4.22
3	AIA GROUP LTD	1299 HK	59,519,544.08	3.94
4	CHINA MOBILE LTD	941 HK	58,111,972.38	3.85
5	CHINA CONSTRUCTION B	939 HK	56,524,690.34	3.75
6	IND & COMM BK OF CHI	1398 HK	35,310,072.05	2.34

7	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	27,822,313.22	1.84
8	CHEUNG KONG HOLDINGS	1 HK	27,175,690.74	1.80
9	HONG KONG EXCHANGES	388 HK	24,812,713.99	1.64
10	PING AN INSURANCE GR	2318 HK	21,073,752.54	1.40
11	CNOOC LTD	883 HK	17,839,590.06	1.18
12	CHINA PETROLEUM & CH	386 HK	15,302,994.83	1.01
13	CLP HOLDINGS LTD	2 HK	15,224,802.33	1.01
14	CHINA LIFE INSURANCE	2628 HK	15,146,712.52	1.00
15	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	1113 HK	14,288,064.42	0.95
16	SUN HUNG KAI PROPERT	16 HK	12,547,166.48	0.83
17	LINK REIT	823 HK	11,958,337.15	0.79
18	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	11,841,236.86	0.78
19	CITIC Pacific Limited	267 HK	11,485,088.45	0.76
20	HONG KONG & CHINA GA	3 HK	11,359,430.24	0.75

注：-

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	106,827,230.33	7.08
2	HSBC HOLDINGS PLC	5 HK	106,271,801.16	7.04
3	CHINA MOBILE LTD	941 HK	73,517,461.11	4.87
4	AIA GROUP LTD	1299 HK	68,390,435.84	4.53
5	CHINA CONSTRUCTION B	939 HK	55,171,868.57	3.66
6	IND & COMM BK OF CHI	1398 HK	47,949,197.60	3.18
7	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	39,682,132.57	2.63
8	HONG KONG EXCHANGES	388 HK	28,995,660.81	1.92
9	PING AN INSURANCE GR	2318 HK	27,201,102.60	1.80
10	CHINA LIFE INSURANCE	2628 HK	25,339,839.09	1.68
11	CHEUNG KONG HOLDINGS	1 HK	25,265,294.45	1.67

12	CNOOC LTD	883 HK	23,286,003.43	1.54
13	SUN HUNG KAI PROPERT	16 HK	20,619,222.04	1.37
14	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	19,894,069.55	1.32
15	CHINA PETROLEUM & CH	386 HK	17,925,862.32	1.19
16	CLP HOLDINGS LTD	2 HK	15,615,268.64	1.03
17	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	1113 HK	15,400,091.59	1.02
18	HONG KONG & CHINA GA	3 HK	13,020,441.54	0.86
19	LINK REIT	823 HK	12,777,338.23	0.85
20	CHINA OVERSEAS LAND	688 HK	12,719,327.38	0.84

注：-

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	756,430,795.53
卖出收入（成交）总额	912,024,855.69

注：-

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	期货品种_股指	HSI1701	255,387,972.06	17.48

注：-

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

注：本基金本报告期末未持有基金。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1

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

### 8.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	16,512,654.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	106,691.61
4	应收利息	18,031.92
5	应收申购款	465,801.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,103,179.80

注：-

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
汇添富恒生指数分级(QDII)	5,700.00	45,749.10	110,665,475.15	42.44	150,104,380.24	57.56
恒生 a	640.00	932,258.05	529,440,125.00	88.74	67,205,024.00	11.26
恒生 b	11,550.00	51,657.59	159,604,732.00	26.75	437,040,417.00	73.25
-	-	-	-	-	-	-
合计	17,890.00	81,277.82	799,710,332.15	55.00	654,349,821.24	45.00

注：-

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

恒生 A			
序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)

1	中国银河证券股份有 限公司	66,316,471.00	11.11
2	中国太平洋人寿保险 股份有限公司—分红 —个人分红	54,698,648.00	9.17
3	银华财富资本—工商 银行—银华财富资本 管理（北京）有限公 司	38,261,060.00	6.41
4	工银瑞信基金—农业 银行—中油财务有限 责任公司	38,152,474.00	6.39
5	广发基金—招商银行 —招商财富资产管理 有限公司	30,583,895.00	5.13
6	全国社保基金—零零 八组合	28,215,534.00	4.73
7	中国太平洋人寿保险 股份有限公司—传统 —普通保险产品	24,439,266.00	4.10
8	银华基金—工商银行 —中国工商银行股份 有限公司私人银行部	24,000,000.00	4.02
9	广东君之健投资管理 有限公司—君之健翱 翔稳进证券投资基金	18,624,500.00	3.12
10	银华基金—平安银行 —南方资本管理有限 公司	18,079,337.00	3.03
恒生 B			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	瑞泰人寿保险有限公 司—万能	64,435,031.00	10.80
2	中国对外经济贸易信 托有限公司—昀洋证 券投资集合资金信托 计划	14,354,371.00	2.41
3	中国对外经济贸易信 托有限公司—外贸信 托·伏牛 2 期(汇富 14	10,476,310.00	1.76
4	中国对外经济贸易信 托有限公司—外贸信 托—明泓多策略对冲 私募	9,680,793.00	1.62

5	兴业全球基金—工商银行—兴全特定策略33号特定多客户资产管理	7,044,344.00	1.18
6	丁锦滢	6,452,756.00	1.08
7	唐智利	5,884,232.00	0.99
8	袁杰	5,754,100.00	0.96
9	杨继耘	5,501,000.00	0.92
10	中信证券—中信银行—中信证券卓越成长股票集合资产管理计划	5,389,000.00	0.90
添富恒生			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	刘泳	7,000,000.00	15.00
2	富国基金—广州农商银行—民生证券股份有限公司	4,558,600.00	9.77
3	上海明泫投资管理有限公司—明泫全天候一号基金	4,059,800.00	8.70
4	万端玉	2,246,234.00	4.81
5	中信证券股份有限公司	1,001,710.00	2.15
6	义乌市浪莎小额贷款股份有限公司	949,991.00	2.04
7	周文东	780,430.00	1.67
8	蒋长怡	740,049.00	1.59
9	中信信托有限责任公司—上善若水3期成长策略精选管理型证券	740,000.00	1.59
10	刘壮波	650,000.00	1.39

注：-

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	恒生 A		-
	恒生 B	-	-
	添富恒生	95,668.77	0.0367
	合计	95,668.77	0.0066

注：-

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

注：-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	恒生 A	恒生 B	添富恒生
基金合同生效日 2014 年 03 月 06 日基金份额总额	109,711,438.00	109,711,438.00	1,051,208,262.98
本报告期初基金份额总额	718,983,211.00	718,983,211.00	129,198,186.27
本报告期基金总申购份额	-	-	1,673,277,978.71
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	1,835,634,321.36
本报告期基金拆分变动份额	-122,338,062.00	-122,338,062.00	293,928,011.77
本报告期末基金份额总额	596,645,149.00	596,645,149.00	260,769,855.39

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和基金折算后调整份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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、基金管理人于 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、基金管理人 2016 年 7 月 14 日公告，赖中立不再担任汇添富香港优势精选混合型证券投资基金的基金经理，由倪健先生单独管理该基金。

17、《汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 27 日正式生效，顾耀强先生和赵鹏程先生任该基金的基金经理。

18、《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 28 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

19、基金管理人于 2016 年 8 月 2 日公告，增聘余中强先生担任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理，与顾耀强先生、赵鹏程先生共同管理该基金。

20、《汇添富盈稳保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 8 月 3 日正式生效，曾刚先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。

21、基金管理人于 2016 年 8 月 9 日公告，增聘楚天舒女士担任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，与吴振翔先生共同管理该基金。

22、基金管理人于 2016 年 8 月 25 日公告，增聘余中强先生担任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理，同时，韩贤旺先生、顾耀强先生和叶从飞先生不再担任该基金的基金经理。

23、《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2016 年 9 月 18 日正式生效，楚天舒女士任该基金的基金经理。

24、《汇添富保鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 29 日正式生效，曾刚先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。

25、基金管理人于 2016 年 11 月 2 日公告，刘闯先生不再担任汇添富医药保健混合型证券投资基金的基金经理，由周睿先生单独管理该基金。

26、《汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 6 日正式生效，曾刚先生和李怀定先生任该基金的基金经理。

27、《汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 21 日正式生

效，李怀定先生任该基金的基金经理。

28、《汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 12 月 22 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

29、《汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 12 月 22 日正式生效，过蓓蓓女士任该基金的基金经理。

30、《汇添富鑫瑞债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 26 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。

31、《汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 12 月 29 日正式生效，赖中立先生任该基金的基金经理。

32、《汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 12 月 29 日正式生效，过蓓蓓女士任该基金的基金经理。

33、本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 11.3 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、基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所自本基金合同生效日（2014 年 3 月 6 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期末，应付未付的审计费用为人民币伍万元整。

### 11.6 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，本基金管理人高度重视，逐一落实各项整改要求，针对性地制定、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。目前本基金管理人已完成相关整改工作。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	-	119,069,331.26	7.14%	154,530.90	8.58%	-
海通证券	-	1,289,493,154.24	77.28%	1,289,491.68	71.57%	-
招商证券	-	49,234,104.59	2.95%	49,234.48	2.73%	-
瑞士信贷	-	11,109,308.72	0.67%	8,887.45	0.49%	-
凯基证券	-	199,679,947.65	11.97%	299,519.94	16.62%	-

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。

### 11.7.2 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
东方证券	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
海通证券	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
招商证券	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
瑞士信贷	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
凯基证券	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%

注：专用交易单元的选择标准和程序：（1）基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。（2）交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。（3）投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。（5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由

投资研究部决定，投资总监审批。（6）成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。（7）调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

### 11.8 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	公司网站,	2016-01-04
2	汇添富基金管理股份有限公司关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断后调整旗下部分基金申购与赎回开放时间的公告	公司网站,	2016-01-04
3	汇添富基金管理股份有限公司关于调整指数熔断机制下的基金申购与赎回开放时间的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 上交所, 深交所,	2016-01-04
4	汇添富基金管理股份有限公司关于公司注册资本及股权变更的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-01-04
5	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金之恒生 A 份额本次定期折算期间约定年基准收益率的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 深交所,	2016-01-05
6	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间添富恒生份额、恒生 A 份额停复牌的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 深交所,	2016-01-05
7	汇添富基金管理股份有限公司关于指数熔断期间旗下场内基金申购赎回业务安排的提示性公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 深交所,	2016-01-06
8	关于添富恒生份额、恒生 A 份额定期份额折算后复牌首日前收盘价调整的风险提示公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 深交所,	2016-01-06
9	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 深交所,	2016-01-06
10	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	公司网站,	2016-01-07
11	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	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-01-20

12	汇添富旗下公募基金 2015 年第 4 季度报告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 上交所, 深交所,	2016-01-21
13	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	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-01-27
14	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	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-02-18
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加新兰德为销售机构的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-02-20
16	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	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-02-20
17	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	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-02-24
18	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加宜信普泽为销售机构的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-02-27
19	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在大同证券开通定投业务的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-03-04
20	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	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-03-16
21	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 深交所,	2016-03-23
22	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	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-03-28
23	汇添富旗下公募基金 2015 年年度报告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 上交所, 深交所,	2016-03-29
24	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	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-03-31

25	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）	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-04-02
26	汇添富恒生指数分级证券投资基金基金更新招募说明书摘要（2016年第1号）	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-04-20
27	公募基金 2016 年第 1 季度报告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 上交所, 深交所,	2016-04-20
28	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	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-05-12
29	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	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-05-12
30	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加云湾投资为销售机构的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-06-24
31	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 深交所,	2016-06-29
32	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加京东费率优惠活动的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-06-30
33	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的申购基金费率优惠活动的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-06-30
34	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2016 年上半年度资产净值的公告	公司网站	2016-07-01
35	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加晟视天下为销售机构的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-08-25
36	汇添富旗下公募基金 2016 年半年度报告及摘要	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 上交所, 深交所,	2016-08-27
37	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的电子渠道申购基金、定投基金费率优惠活动的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-09-20
38	汇添富基金管理股份有限公司关	中证报, 上证报, 证	2016-09-21

	于旗下部分基金参加东方证券开展的申购基金、定投基金费率优惠活动的公告	券时报, 公司网站,	
39	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 深交所,	2016-09-30
40	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加厦门鑫鼎盛为销售机构的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-10-15
41	汇添富恒生指数分级证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 2 号）	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 深交所,	2016-10-20
42	汇添富旗下公募基金 2016 年第 3 季度报告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 上交所, 深交所,	2016-10-25
43	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加南京证券为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-10-26
44	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加广源达信开展的申购、定投基金费率优惠活动的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-11-09
45	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加凯石财富开展的申购基金、定投基金费率优惠活动的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-11-12
46	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金通过网上直销申购、定投金额下限的公告	上证报, 中证报, 证券时报, 公司网站,	2016-11-17
47	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金单笔申购、定投金额下限的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-11-18
48	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加银河证券为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-11-21
49	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的电子渠道申购基金、定投基金费率优惠活动的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-11-29
50	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金通过诺亚正	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-12-03

	行申购、定投金额下限的公告		
51	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加蛋卷基金为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-12-03
52	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代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-12-06
53	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加弘业期货为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站,	2016-12-06
54	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加新浪基金为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-12-15
55	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的电子渠道申购、定投基金费率优惠活动的公告	上证报, 中证报, 证券时报, 公司网站,	2016-12-22
56	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 深交所,	2016-12-22
57	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行开展的申购、定投基金费率优惠活动的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-12-23
58	汇添富基金管理股份有限公司关于公司注册资本及股权变更的公告	上证报, 中证报, 证券时报, 公司网站,	2016-12-24
59	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	上证报, 中证报, 证券时报, 公司网站, 深交所,	2016-12-28
60	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金办理定期折算业务的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站, 深交所,	2016-12-28
61	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行开展的定投基金费率优惠活动的公告	中证报, 上证报, 证券时报, 公司网站,	2016-12-29

注:-



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 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

### 12.3 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

2017 年 3 月 29 日