

汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券  
投资基金  
2017 年半年度报告摘要

2017 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：2017 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富沪深 300 安中指数
基金主代码	000368
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 6 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	228,555,140.46 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪沪深 300 安中动态策略指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。
投资策略	主要采取完全复制法。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	沪深 300 安中动态策略指数收益率 $\times$ 95% + 金融机构人民币活期存款基准利率（税后） $\times$ 5%。
风险收益特征	本基金属于股票型指数基金，在证券投资基金中属于较高预期风险、较高预期收益的品种，本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数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	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

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

## § 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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	11,591,369.25
本期利润	35,487,964.88
加权平均基金份额本期利润	0.1629
本期基金份额净值增长率	12.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.3258
期末基金资产净值	336,866,253.62
期末基金份额净值	1.4739

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

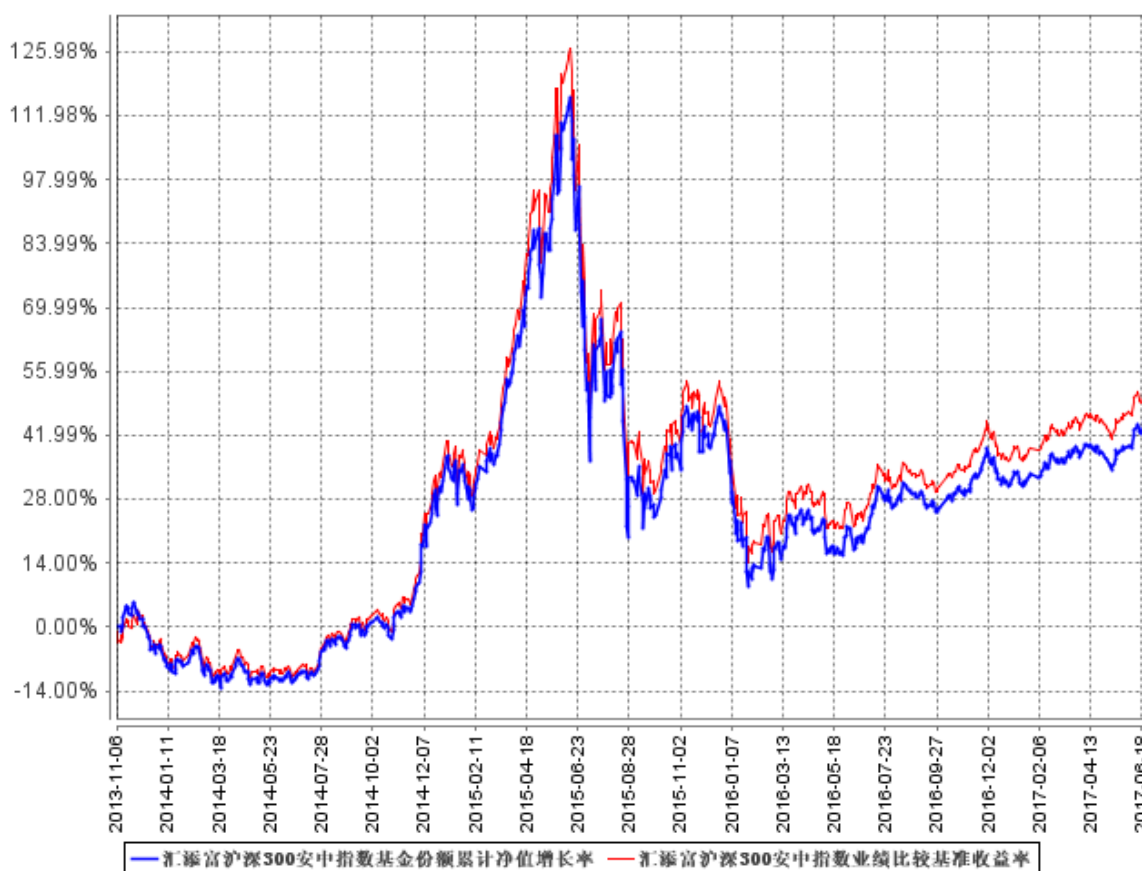
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.47%	0.62%	4.87%	0.62%	0.60%	0.00%
过去三个月	6.82%	0.56%	6.72%	0.54%	0.10%	0.02%
过去六个月	12.36%	0.54%	12.70%	0.54%	-0.34%	0.00%
过去一年	21.10%	0.65%	21.48%	0.65%	-0.38%	0.00%

过去三年	63.97%	1.79%	69.73%	1.72%	-5.76%	0.07%
自基金合同生效日起至 今	47.39%	1.68%	54.20%	1.62%	-6.81%	0.06%

### 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

汇添富沪深300安中指数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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013 年 11 月 6 日）起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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 132,724,224 元人民币。截止到 2017 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 2898.83 亿元，有效客户数约 1500 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 85 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、汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）、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、汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金、汇添富盈稳保本混合型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫保本混合型证券投资基金、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金、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）、汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金、汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）、汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金、汇添富鑫利债券型证券投资基金、汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、汇添富中国高端制造股票型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富精选美元债债券型证券投资基金、汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金。

#### 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		
吴振翔	汇添富上证综合指数、汇添富沪深 300 安中指数基金、汇添富成长多因子股票基金、汇添富主要消费 ETF 联接基金、汇添富中证精准医指数基金、中证上海国企 ETF、汇添富中证互联网医疗指数（LOF）的	2013 年 11 月 6 日	-	11 年	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 5 日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金的基金经理，2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理，

	基金经 理，指 数与 量 化 投 资 部 副 总 监。			2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费 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 基金的基金经理，2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中指数基金的基金经理，2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理，2015 年 3 月 24 日至今任汇添富主要消费 ETF 联接基金的基金经理，2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理，2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理，2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗指数（LOF）的基金经理。
--	---	--	--	---

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易



制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、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 8 次，由于组合投资策略导致，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

上半年国内经济数据一季度回暖，二季度整体保持平稳，出口转暖，企业盈利整体改善，经济保持韧性。政策面上，供给侧改革持续推进，结构性减税降费措施密集推出，混改加速，PPP 持续落地，雄安、粤港澳大湾区、长江经济带等地区经济规划陆续出台，为市场提供了持续的政策热点。此外，全球股市表现良好，人民币汇率稳定，美国新总统执政后，政策不确定性低于预期，为 A 股创造了良好的外部环境。

另一方面，市场结构发生了较大变化。在经济脱虚向实的大背景下，金融、地产领域的监管加强，金融去杠杆的政策主线开始明确；IPO 加速，“壳价值”大幅下降；外延式并购得到控制。市场流动性较为紧张，成交活跃度下降，一些估值过高的行业和中小盘股票价格出现了一定程度的回调。投资者的关注点回归到企业的盈利能力和业绩的稳定性上，一些业绩确定性强、中长期配置价值突出的白马风格的行业和个股受到了市场追捧。在经济平稳、外延并购得到有效控制，供给出清、行业集中度提升背景下，市场预期社会资源可能在未来加速向各行业的龙头公司聚集；同时，纳入 MSCI 引起的境外流入资金也更偏向大盘价值风格，导致上半年大小盘分化明显。同时，供给侧改革持续推进，部分周期行业产能去化充分，盈利得到了较大的提升。具有高盈利、成长稳定、低估值、大市值特性的股票表现出色。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位报告期内基本保持在 92%~95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内安中沪深 300 指数基准上涨 12.70%，本基金在报告期内累计收益率为 12.36%，收益率落后业绩比较基准 0.34%。收益率的差异因素主要来源于期间交易费用、成份股分红、日常申购赎回等因素。本基金日均跟踪误差为 0.0315%，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

下半年经济基本面大概率仍将保持稳中向好的态势。促转型和防风险仍是政策主基调。促转型方面，“放管服”改革优化政府服务，减税降费降低企业负担，租售并举降低个人房租成本，这些措施长期看都有利于经济活力的激发；防风险方面，金融去杠杆、地方政府债务和房地产风险防控可能仍是政策的着力点，虽然可能带来短期的流动性压力，但长期看风险的化解有利于风险偏好的提升。十九大召开将明确未来长期的发展和改革目标，改革路径的明确和逐步落地将给中国经济带来新的活力。此外，一带一路、京津冀、雄安新区、混改、环保等主题在下半年仍可能持续发酵，带来事件性投资机会。国外，美欧步入经济复苏、金融加杠杆的扩张周期，利好中国出口，给中国经济带来良好的外部环境。

股票市场，当前平稳的宏观环境仍较难支撑市场的全面上涨，防风险、去杠杆可能给市场流动性带来压力；但受益于供给侧改革的行业的盈利复苏和改革落地带来的风险偏好改善很可能市场带来正面影响。风格方面，导致大小盘分化的宏观及监管因素在下半年大概率仍将存在，但目前大小盘估值已经大幅收敛，下半年风格差异相比上半年可能减少。行业方面，着眼于长期，增长较为稳定、受益消费升级的消费类行业；受益于出口复苏，代表经济转型和结构升级方向的高科技制造业；与生态文明建设相关的环保行业可能存在投资机会。

安中动态投资于沪深蓝筹标的，在当前市场环境下更具安全性，可能受益于供给侧改革和国企改革的推进，从而带来一定的投资机会。

作为被动投资的指数型基金，汇添富沪深 300 安中动态策略指数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。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、固定收益部、集中交易室、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，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

## 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 4 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

# § 5 托管人报告

## 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的托管过

程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对汇添富基金管理有限公司编制和披露的汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金 2017 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：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金  
报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	22,500,738.46	17,672,425.79
结算备付金	358,924.73	606,444.38
存出保证金	33,763.50	43,744.99
交易性金融资产	312,979,633.95	255,262,004.29
其中：股票投资	312,979,633.95	255,262,004.29
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	1,478,930.03	5,383,739.20
应收利息	3,760.62	3,857.76
应收股利	-	-
应收申购款	264,452.33	171,455.31
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	337,620,203.62	279,143,671.72
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017年6月30日</b>	<b>2016年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	3,641,973.88
应付赎回款	41,380.91	100,361.92
应付管理人报酬	133,402.41	118,443.36
应付托管费	26,680.51	23,688.67
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	233,747.00	413,920.91
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	318,739.17	420,324.37
负债合计	753,950.00	4,718,713.11
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	228,555,140.46	209,201,323.44
未分配利润	108,311,113.16	65,223,635.17
所有者权益合计	336,866,253.62	274,424,958.61
负债和所有者权益总计	337,620,203.62	279,143,671.72

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4739 元，基金份额总额 228,555,140.46 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月
-----	------------------------------	---------------------------------------

	6 月 30 日	30 日
<b>一、收入</b>	37,557,539.32	-40,339,136.94
1.利息收入	74,545.13	56,545.32
其中：存款利息收入	74,529.88	56,271.58
债券利息收入	15.25	273.74
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）	13,552,097.64	-23,807,607.35
其中：股票投资收益	11,562,458.82	-25,389,338.86
基金投资收益	-	-
债券投资收益	715.55	47,281.74
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,988,923.27	1,534,449.77
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	23,896,595.63	-16,636,888.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	34,300.92	48,813.86
<b>减：二、费用</b>	2,069,574.44	2,116,982.33
1. 管理人报酬	741,511.44	596,821.05
2. 托管费	148,302.30	119,364.15
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	910,991.20	1,116,649.69
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	268,769.50	284,147.44
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	35,487,964.88	-42,456,119.27

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	209,201,323.44	65,223,635.17	274,424,958.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	35,487,964.88	35,487,964.88
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）	19,353,817.02	7,599,513.11	26,953,330.13
其中：1. 基金申购款	42,582,786.86	16,300,230.60	58,883,017.46
2. 基金赎回款	-23,228,969.84	-8,700,717.49	-31,929,687.33
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）	228,555,140.46	108,311,113.16	336,866,253.62
	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
项目	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）	199,519,314.21	86,178,978.84	285,698,293.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-42,456,119.27	-42,456,119.27
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）	-381,377.19	-487,380.77	-868,757.96
其中：1. 基金申购款	32,019,398.86	6,470,356.88	38,489,755.74
2. 基金赎回款	-32,400,776.05	-6,957,737.65	-39,358,513.70
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）	199,137,937.02	43,235,478.80	242,373,415.82

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖  
基金管理人负责人

李骁  
主管会计工作负责人

雷青松  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1209 号文《关于核准汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的批复》的核准,由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)作为发起人于 2013 年 10 月 18 日至 2013 年 11 月 4 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2013)验字第 60466941\_B49 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 11 月 6 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 274,987,595.90 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 7,149.29 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 274,994,745.19 元,折合 274,994,745.19 份基金份额。本基金的基金管理人和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。

本基金投资于沪深 300 安中动态策略指数的成份股的组合比例不低于基金资产的 90%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪沪深 300 安中动态策略指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,以便为投资者带来长期收益。本基金的业绩比较基准是沪深 300 安中动态策略指数收益率 $\times$ 95%+金融机构人民币活期存款基准利率(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编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

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

#### 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、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 2、营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税字[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以及金融同业往来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，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券

取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，对资管产品在 2018 年 1 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、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、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 4、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，对资管产品在 2018 年 1 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。

## 6.4.7 关联方关系

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

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

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、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

注：以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 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。

#### 6.4.8.1.3 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。

#### 6.4.8.1.4 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。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本期及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	741,511.44	596,821.05
其中：支付销售机构的客户维护费	36,029.10	31,575.00

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	148,302.30	119,364.15

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末和上年度末未投资本基金。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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	22,500,738.46	68,214.19	15,211,955.40	50,162.16

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603305	旭升	2017 年 6 月	2017 年	新股流	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-

	股份	月 30 日	7 月 10 日	通受限						
300670	大 烨 智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流 通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
603331	百 达 精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流 通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君 禾 股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流 通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
600050	中国 联通	2017 年 4 月 5 日	重大 事项 停牌	6.85	2017 年 8 月 21 日	8.22	1,663,468	10,880,365.69	11,394,755.80	-
600795	国电 电力	2017 年 6 月 5 日	重大 资产 重组 停牌	3.60	-	-	2,663,048	9,360,384.70	9,586,972.80	-
601088	中国 神华	2017 年 6 月 5 日	重大 事项 停牌	22.29	-	-	174,911	2,830,378.20	3,898,766.19	-
002252	上海 莱士	2017 年 4 月 21 日	重大 事项 停牌	20.35	-	-	139,370	2,899,465.69	2,836,179.50	-
600485	信威 集团	2017 年 4 月 27 日	重大 资产 重组 停牌	14.59	-	-	173,842	3,443,861.58	2,536,354.78	-
300104	乐视 网	2017 年 4 月 17 日	重大 资产 重组 停牌	30.68	-	-	30,365	1,406,534.47	931,598.20	-
601989	中国 重工	2017 年 5 月 31 日	重大 资产 重组	6.21	-	-	124,100	870,274.19	770,661.00	-

			停牌								
600100	同方股份	2017年4月21日	重大资产重组停牌	14.12	-	-	47,487	681,603.95	670,516.44	-	
000100	TCL集团	2017年4月21日	重大事项停牌	3.43	2017年7月26日	3.72	142,965	551,428.35	490,369.95	-	
000503	海虹控股	2017年5月11日	重大资产重组停牌	24.93	-	-	19,639	739,909.14	489,600.27	-	
601727	上海电气	2017年6月22日	重大事项停牌	7.57	2017年7月3日	7.54	51,791	579,162.60	392,057.87	-	
600666	奥瑞德	2017年4月27日	重大资产重组停牌	17.40	-	-	21,280	392,982.44	370,272.00	-	
600959	江苏有线	2017年6月19日	重大资产重组停牌	10.57	-	-	33,330	374,754.29	352,298.10	-	
601919	中远海控	2017年5月17日	重大资产重组停牌	5.35	2017年7月26日	5.89	54,914	309,194.30	293,789.90	-	
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项停牌	8.27	-	-	35,287	341,170.36	291,823.49	-	
002049	紫光国芯	2017年2月20日	重大资产重组停牌	30.82	2017年7月17日	27.74	9,300	306,830.25	286,626.00	-	
002426	胜利精密	2017年1月16日	重大事项停牌	7.68	-	-	36,100	298,187.00	277,248.00	-	
300085	银之杰	2017年6月30日	重大事项停牌	18.50	2017年7月7日	18.88	9,500	219,014.65	175,750.00	-	
601872	招商轮船	2017年5月2日	重大事项停牌	5.16	-	-	32,000	171,186.48	165,120.00	-	
601608	中信	2017	重大	5.54	2017	5.26	24,300	136,047.62	134,622.00	-	

	重工	年 4 月 19 日	事项停牌		年 7 月 26 日					
000061	农产品	2017 年 6 月 28 日	重大事项停牌	9.06	-	-	14,670	166,334.12	132,910.20	-
603501	韦尔股份	2017 年 6 月 5 日	重大资产重组停牌	20.15	-	-	1,657	11,632.14	33,388.55	-

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	312,979,633.95	92.70
	其中：股票	312,979,633.95	92.70
6	银行存款和结算备付金合计	22,859,663.19	6.77
7	其他各项资产	1,780,906.48	0.53
8	合计	337,620,203.62	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,119,099.08	0.33
B	采矿业	24,456,057.89	7.26
C	制造业	150,051,407.14	44.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	54,382,539.43	16.14
E	建筑业	6,974,570.76	2.07
F	批发和零售业	8,970,051.26	2.66
G	交通运输、仓储和邮政业	4,552,004.31	1.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,345,056.61	7.52
J	金融业	20,167,309.78	5.99
K	房地产业	4,455,979.28	1.32
L	租赁和商务服务业	3,097,806.92	0.92
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,430,005.23	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	712,786.44	0.21
R	文化、体育和娱乐业	5,478,912.96	1.63
S	综合	400,907.44	0.12
	合计	312,594,494.53	92.79

## 7.2.2 期末积极投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	380,188.21	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	510.24	0.00
F	批发和零售业	-	-
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	2,192.36	0.00

J	金融业	833.49	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,415.12	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	385,139.42	0.11

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

### 7.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600900	长江电力	1,016,462	15,633,185.56	4.64
2	600519	贵州茅台	29,683	14,005,923.55	4.16
3	600050	中国联通	1,663,468	11,394,755.80	3.38
4	600887	伊利股份	516,732	11,156,243.88	3.31
5	000858	五粮液	193,668	10,779,560.88	3.20
6	600795	国电电力	2,663,048	9,586,972.80	2.85
7	601985	中国核电	1,073,300	8,382,473.00	2.49
8	600886	国投电力	954,672	7,541,908.80	2.24
9	000063	中兴通讯	299,828	7,117,916.72	2.11
10	600028	中国石化	916,651	5,435,740.43	1.61

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 的年度报告正文。

### 7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01

2	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
3	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.01
4	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.01
5	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01

## 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	600887	伊利股份	14,055,912.10	5.12
2	600519	贵州茅台	13,662,492.50	4.98
3	000858	五粮液	11,271,700.94	4.11
4	000063	中兴通讯	11,258,707.14	4.10
5	600900	长江电力	8,224,506.63	3.00
6	600276	恒瑞医药	7,611,356.20	2.77
7	002304	洋河股份	6,655,338.00	2.43
8	002465	海格通信	6,580,389.00	2.40
9	600795	国电电力	6,289,659.00	2.29
10	601985	中国核电	5,873,042.45	2.14
11	600518	康美药业	5,775,536.00	2.10
12	000333	美的集团	5,469,357.00	1.99
13	600050	中国联通	5,269,112.68	1.92
14	600886	国投电力	5,121,807.75	1.87
15	000651	格力电器	5,003,619.00	1.82
16	000538	云南白药	4,535,269.38	1.65
17	000568	泸州老窖	4,028,132.72	1.47
18	600498	烽火通信	3,850,103.00	1.40
19	600023	浙能电力	3,813,128.07	1.39
20	000423	东阿阿胶	3,516,511.00	1.28

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	000063	中兴通讯	18,072,745.38	6.59
2	002465	海格通信	9,943,257.60	3.62
3	600028	中国石化	9,352,675.00	3.41
4	600276	恒瑞医药	8,386,908.20	3.06
5	600519	贵州茅台	8,044,060.79	2.93
6	600887	伊利股份	7,790,800.00	2.84
7	601857	中国石油	7,311,179.96	2.66
8	600498	烽火通信	6,633,006.13	2.42
9	600518	康美药业	6,324,033.00	2.30
10	601088	中国神华	5,908,913.00	2.15
11	000651	格力电器	5,429,178.00	1.98
12	000858	五粮液	5,411,597.00	1.97
13	000333	美的集团	5,336,803.00	1.94
14	000538	云南白药	4,703,027.90	1.71
15	600050	中国联通	4,173,120.00	1.52
16	002450	康得新	4,080,479.00	1.49
17	000568	泸州老窖	3,720,329.80	1.36
18	000423	东阿阿胶	3,598,133.82	1.31
19	002304	洋河股份	3,510,698.00	1.28
20	600157	永泰能源	3,495,413.70	1.27

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	318,221,537.60
卖出股票收入（成交）总额	296,031,235.58

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资组合。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末无股指期货持仓。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：报告期末本基金无国债期货持仓。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	33,763.50
2	应收证券清算款	1,478,930.03
3	应收股利	-
4	应收利息	3,760.62
5	应收申购款	264,452.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,780,906.48

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资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	600795	国电电力	9,586,972.80	285.00	重大资产重组停牌
2	600050	中国联通	11,394,755.80	338.00	重大事项停牌

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五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	603501	韦尔股份	33,388.55	0.01	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
3,654	62,549.30	177,208,900.20	77.53%	51,346,240.26	22.47%

### 8.3 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	80,270.14	0.0351%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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（2013 年 11 月 6 日）基金份额总额	274,994,745.19
本报告期期初基金份额总额	209,201,323.44
本报告期基金总申购份额	42,582,786.86
减:本报告期基金总赎回份额	23,228,969.84
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	228,555,140.46

注：其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 《汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日正式生效，韩贤旺先生任该基金的基金经理。
2. 基金管理人于 2017 年 2 月 4 日公告，增聘欧阳沁春先生和杨璿先生担任汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与韩贤旺先生共同管理该基金。
3. 《汇添富鑫利债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 13 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。
4. 基金管理人于 2017 年 3 月 10 日公告，李骁先生任基金管理人副总经理。
5. 《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 15 日正式生效，顾耀强先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。
6. 基金管理人于 2017 年 3 月 16 日公告，增聘吴江宏先生担任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理，与顾耀强先生共同管理该基金。
7. 《汇添富中国高端制造股票型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 20 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。
8. 《汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 14 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。
9. 《汇添富精选美元债债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，何旻先生和高欣先生任该基金的基金经理。
10. 《汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
11. 《汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
12. 《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 15 日正式生效，曾刚先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
13. 基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，聘任郑慧莲女士为汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金和汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。
14. 基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理该基金。



15. 基金管理人 2017 年 6 月 21 日公告，雷鸣先生不再担任汇添富新兴消费股票型证券投资基金的基金经理，由刘伟林先生单独管理该基金。

16. 《汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 6 月 23 日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。

17. 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、基金财产的诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)自本基金合同生效日(2013 年 11 月 6 日)起至本报告期末，为本基金进行审计。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
东兴证券	2	609,581,219.42	100.00%	562,636.01	100.00%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

东北证券	2	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东兴证券	58,730.80	100.00%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。
- (8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 2 个交易单元：太平洋证券（上交所交易单元和深交所交易单元）。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	154,184,079.99	-	-	154,184,079.99	67.46%

个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或其他基金合并。

注：无。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

汇添富基金管理股份有限公司  
2017 年 8 月 26 日