

# 汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金 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	汇添富盈鑫保本混合
基金主代码	002420
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月11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	3,929,958,274.25份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资组合保险技术来运作，在保证本金安全的前提下，力争在保本期内实现基金财产的稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，利用组合保险技术，动态调整安全资产与风险资产的投资比例，以确保基金在保本周期到期时，实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。安全资产主要包括国债、央行票据、银行存款等品种。风险资产主要包括股票、权证、股指期货等品种。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率（税后）。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。 投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

### 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	-7,818,717.08
本期利润	131,885,707.14
加权平均基金份额本期利润	0.0310
本期基金份额净值增长率	3.21%
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	0.0160
期末基金资产净值	4,044,273,706.29
期末基金份额净值	1.029

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。

#### 3.2 基金净值表现

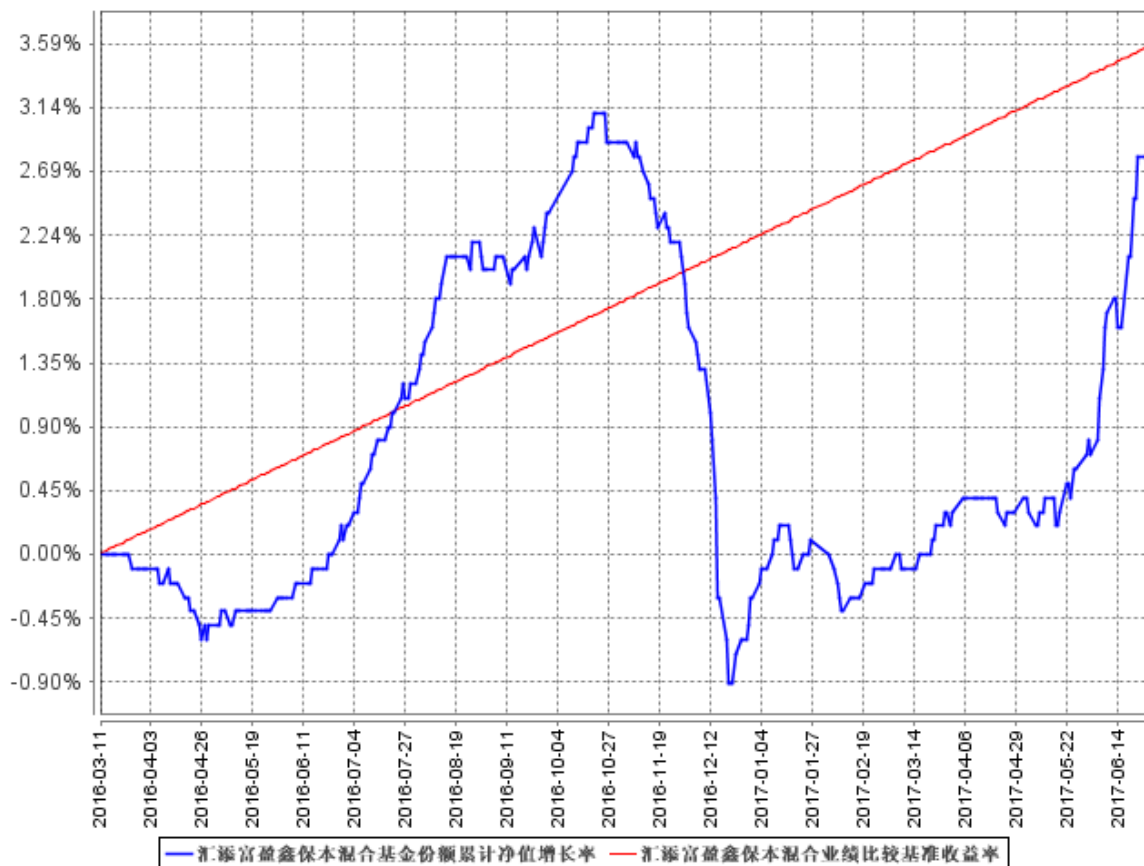
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.18%	0.18%	0.23%	0.01%	1.95%	0.17%
过去三个月	2.59%	0.13%	0.69%	0.01%	1.90%	0.12%
过去六个月	3.21%	0.10%	1.36%	0.01%	1.85%	0.09%
过去一年	2.69%	0.12%	2.75%	0.01%	-0.06%	0.11%
自基金合同生效日起至 今	2.90%	0.10%	3.59%	0.01%	-0.69%	0.09%

注：本基金的《基金合同》生效日为2016年3月11日，至本报告期末未满3年。

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

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



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016年3月11日）起6个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金的《基金合同》生效日为2016年3月11日，至本报告期末未满3年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立，注册资本金为 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、汇添富医疗保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富优选回报混合型证券投资基金、汇添富消费行业混合型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽 30 混合型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富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		
何旻	汇添富安心中国债券基金、汇添富6月红定期开放债券基金、汇添富盈鑫保本混合基金、汇添富美元债债券	2016年3月11日	-	19年	国籍：中国。学历：英国伦敦政治经济学院金融经济学硕士。相关业务资格：基金从业资格、特许金融分析师（CFA），财务风险经理（FRM）。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司行业研究员、综合研究小组负责人、基金经理助理，固定收益部负责人；金元比联基金管理有限公司基金经理。2004年10



	(QDII) 基金的基金经理。				<p>月 28 日至 2006 年 11 月 11 日担任国泰金龙债券基金的基金经理, 2005 年 10 月 27 日至 2006 年 11 月 11 日担任国泰金象保本基金的基金经理, 2006 年 4 月 28 日至 2006 年 11 月 11 日担任国泰金鹿保本基金的基金经理。2007 年 8 月 15 日至 2010 年 12 月 29 日担任金元比联宝石动力双利债券基金的基金经理, 2008 年 9 月 3 日至 2009 年 3 月 10 日担任金元比联成长动力混合基金的基金经理, 2009 年 3 月 29 日至 2010 年 12 月 29 日担任金元比联丰利债券基金的基金经理。</p> <p>2011 年 1 月加入汇添富资产管理(香港)有限公司, 2012 年 2 月 17 日至今任汇添富人民币债券基金的基金经理。2012 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司, 2013 年 11 月 22 日至今任汇添富安心中国债券基金的基金经理, 2014 年 1 月 21 日至今任汇添富 6 月红定期开放债券基金(原汇添富信用债券基金)的基金经理, 2016 年 3 月 11 日至今任汇添富盈鑫保本混合基金的基金经理, 2017 年 4 月 20 日至今任汇添富美元债债券(QDII)基金的基金经理。</p>
李怀定	汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富纯债(LOF)基	2016 年 3 月 11 日	-	10 年	<p>国籍: 中国。学历: 复旦大学经济学博士。相关业务资格: 基金从业资格。从业经历: 曾任光大证券股份有限公司研究所债券分析师, 国信证券股份有</p>

	<p>金、汇添富达欣混合基金、汇添富盈鑫保本混合基金、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富长添利定期开放债券基金、汇添富新睿精选混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、添富年年泰定开混合基金的基金经理，汇添富增强收益债券基金的基金经理助理。</p>			<p>限公司经济研究所固定收益高级分析师。2012 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益高级分析师。2015 年 5 月 25 日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理助理，2015 年 11 月 18 日至今任汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富纯债 (LOF) 基金 (原汇添富互利分级债券基金) 的基金经理，2015 年 12 月 2 日至今任汇添富达欣混合基金的基金经理，2016 年 3 月 11 日至今任汇添富盈鑫保本混合基金的基金经理，2016 年 3 月 16 日至今任汇添富稳健添利定期开放债券基金的基金经理，2016 年 12 月 6 日至今任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理，2016 年 12 月 21 日至今任汇添富新睿精选混合基金的基金经理，2016 年 12 月 26 日至今任汇添富鑫瑞债券基金的基金经理，2017 年 4 月 14 日至今任添富年年泰定开混合基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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

2017 年上半年国内经济总体延续去年四季度以来回升态势，尽管受地产调控和制造业去库存周期结束的影响，经济的内生动力依然不是很强，但企业盈利、民间投资和信贷融资需求等多项指标明显获得改善，而且即使二季度投资增速有所回落，但在外需改善下，工业生产和出口总体保持稳定，特别是三四线城市的地产销售和投资超预期，使得经济短期内呈现出一定的韧性，市场对国内经济的回升信心较去年有所恢复。外部环境方面，欧美走势出现较大分歧，美国经济在特朗普上台后表现相对较弱，除了失业率继续下降外，就业、薪资和通胀等指标趋势上都低于预期；相对而言，欧洲经济上半年在持续改善，无论是经济增长还是就业，表现都好于预期。2017

年上半年前期 PPI 受供给侧改革推动持续高涨，但后期受制造业去库存周期结束的影响，开始明显下行，并带来企业盈利扩张放缓；尽管 CPI 表现相对温和，但整体而言，通胀压力大幅缓解。货币政策上，一季度在金融去杠杆大环境下，叠加美联储加息影响，央行在公开市场上持续回笼资金、两次上调政策利率，虽然期间央行在关键时点向市场投入流动性，但保持货币市场紧平衡意图明显；二季度开始货币政策延续一季度的偏紧基调，但在 4 月“两会”的监管力度全面升级后，央行在 5 月末提前引导市场预期，表示会重启 28 天逆回购、对冲到期的 MLF，政策基调上出现明显的边际改善迹象。

2017 年上半年债券市场出现大起大落，5 月上旬之前延续去年 4 季度的调整行情，随着经济回升、金融去杠杆、公开市场利率上调和监管竞争的加剧，债券收益率出现显著上行，但 5 月中旬后随着监管协调预期加强，叠加货币政策边际上有所放松与债券收益率存在较明显的配置价值，债券市场收益率又开始出现显著下行，但上半年总体而言，债券收益率仍出现较大幅度上行。上半年债券市场收益率曲线平坦化趋势明显，信用债评级利差也出现较大波动，但总体有所拉大。上半年股票表现以龙头和价值股为主，中小盘和创业板表现偏弱，整体看，上证综指整体上涨 2.86%，深圳成指上涨 3.46%，创业板下跌-7.07%。

本基金在年初以来严格按照《关于避险策略基金的指导意见》的要求，对稳健资产和风险资产进行积极调整，并在上半年后期债券收益率大幅上行之后大幅调低了债券稳健资产的配置比例，但整体组合久期较去年末有所下降；股票操作上，上半年后期在组合安全垫有所提高后，适当增加了股票配置比例，且以蓝筹股为主，个股也保持相对稳定。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0290 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.21%，业绩比较基准收益率为 1.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，鉴于政治局会议透露经济工作重点可能会对地方政府债务融资和房地产融资有所约束，基建投资和房地产投资增速可能有向下动力，尽管考虑三四线城市房地产投资超预期使得经济明显下台阶的可能性不大，但对债券市场不利的作用相对上半年会有所减弱。货币政策上，上半年债券收益率整体大幅上行，政策继续收紧的必要性在明显减弱，从金融工作会议的基调看，监管协调在下半年会更加明显，货币市场流动性有望保持相对适中的局面。债券判断上，考虑上半年债券收益率上升幅度较大，下半年债券收益率中枢有望有所出现一定幅度的下行，但期限需

要关注信用分化带来的估值不利影响，也需要关注供给侧改革对大宗商品进而对通胀的冲击。股票上，下半年继续看好蓝筹股，但作为绝对收益组合，仍会根据安全垫情况合理控制股票底仓的回撤风险；另外，组合会继续积极参与新股一级市场申购。

我们在严格按照保本基金的严格运作框架下，坚持价值投资的理念，重视绝对收益目标，积极调整组合结构，控制组合下行风险，力争在确保本券安全基础之上，为投资者创造持续稳定的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、基金营运部和稽核监察部人员组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有丰富的证券基金行业从业经验，能够胜任估值决策工作，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理不介入基金日常估值业务，但可以参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在复核相关基金分红条件的前提下，保本周期内，基金分红仅采取现金分红一种收益分配方式；基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为基准；基金收益分配后，基金份额净值不得低于面值。

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

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

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

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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金 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：汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金

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	826,106,244.20	4,341,375.21
结算备付金	52,291,104.39	37,990,051.87
存出保证金	489,327.16	211,538.66
交易性金融资产	4,880,022,877.03	4,545,595,531.03
其中：股票投资	456,658,219.03	86,660,973.71
基金投资	-	-
债券投资	4,423,364,658.00	4,458,934,557.32
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	84,194,010.52	438,434.12
应收利息	75,829,077.93	83,105,932.56
应收股利	-	-
应收申购款	699.16	2,896.52
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,918,933,340.39	4,671,685,759.97
<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	1,785,800,000.00	212,000,000.00
应付证券清算款	80,047,366.53	-
应付赎回款	3,436,885.81	1,765,839.18
应付管理人报酬	4,020,531.33	4,585,237.40
应付托管费	670,088.55	764,206.24
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	351,294.15	365,759.55

应交税费	-	-
应付利息	55,836.54	16,002.71
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	277,631.19	290,000.00
负债合计	1,874,659,634.10	219,787,045.08
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	3,929,958,274.25	4,466,254,119.13
未分配利润	114,315,432.04	-14,355,404.24
所有者权益合计	4,044,273,706.29	4,451,898,714.89
负债和所有者权益总计	5,918,933,340.39	4,671,685,759.97

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.029 元，基金份额总额 3,929,958,274.25 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2016 年 3 月 11 日(基金合同 生效日)至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	181,337,810.50	31,119,704.17
1.利息收入	100,283,116.21	46,989,456.03
其中：存款利息收入	18,808,822.29	9,252,898.28
债券利息收入	81,389,377.81	37,297,009.60
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	84,916.11	439,548.15
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-61,286,241.82	-3,426,414.02
其中：股票投资收益	18,878,730.07	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-82,184,410.19	-3,503,414.02
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	2,019,438.30	77,000.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	139,704,424.22	-14,208,552.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,636,511.89	1,765,214.47



<b>减：二、费用</b>	49,452,103.36	23,015,415.62
1. 管理人报酬	25,447,570.55	17,513,240.58
2. 托管费	4,241,261.74	2,918,873.43
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,150,213.91	83,452.94
5. 利息支出	18,402,783.46	2,373,058.91
其中：卖出回购金融资产支出	18,402,783.46	2,373,058.91
6. 其他费用	210,273.70	126,789.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	131,885,707.14	8,104,288.55

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金

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）	4,466,254,119.13	-14,355,404.24	4,451,898,714.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	131,885,707.14	131,885,707.14
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）	-536,295,844.88	-3,214,870.86	-539,510,715.74
其中：1.基金申购款	1,660,863.86	16,013.58	1,676,877.44
2.基金赎回款	-537,956,708.74	-3,230,884.44	-541,187,593.18
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）	3,929,958,274.25	114,315,432.04	4,044,273,706.29
项目	上年度可比期间 2016 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	4,849,549,217.33	-	4,849,549,217.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,104,288.55	8,104,288.55
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)	-80,266,593.73	243,724.18	-80,022,869.55
其中：1.基金申购款	8,267,569.80	-29,672.98	8,237,896.82
2.基金赎回款	-88,534,163.53	273,397.16	-88,260,766.37
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)	4,769,282,623.60	8,348,012.73	4,777,630,636.33

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

李骁

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金(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 2016 194 号文《关于准予汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司作为基金管理人于 2016 年 2 月 26 日至 2016 年 3 月 8 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(2016)验字第 60466941\_B04 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 2016 年 3 月 11 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 4,848,571,685.14 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 977,532.19 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 4,849,549,217.33 元，折合 4,849,549,217.33 份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金参与融资业务。本基金主要通过投资组合保险技术来运作，在保证本金安全的前提下，力争在保本期内实现基金财产的稳健增值。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款收益率（税后）。

汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金（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〔2016〕194号文《关于准予汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司作为发起人于2016年2月26日至2016年3月8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(2016)验字第60466941\_B04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2016年3月11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4,848,571,685.14元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币977,532.19元，以上实收基金（本息）合计为人民币4,849,549,217.33元，折合4,849,549,217.33份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金参与融资业务。本基金主要通过投资组合保险技术来运作，在保证本金安全的前提下，力争在保本期内实现基金财产的稳健增值。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款收益率（税后）。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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 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

### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

#### 6.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入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。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

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

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 关联方关系

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

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

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年3月11日(基金合同生效日)至 2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东方证券股份有限公司	827,494,110.12	99.65%	46,980,431.89	100.00%

#### 6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年3月11日(基金合同生效日)至 2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东方证券股份有限公司	4,124,916,086.56	99.99%	2,006,181,766.92	100.00%

### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年3月11日(基金合同生效日)至 2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
东方证券股份有 限公司	54,527,927,000.00	100.00%	12,899,956,000.00	100.00%

### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东方证券股份有 限公司	760,987.41	99.66%	343,686.95	99.24%
关联方名称	上年度可比期间 2016年3月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东方证券股份有 限公司	43,066.98	100.00%	43,066.98	100.00%

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

### 6.4.8.2 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3月11日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
----	--------------------------------	---



当期发生的基金应支付的管理费	25,447,570.55	17,513,240.58
其中：支付销售机构的客户维护费	8,655,423.87	6,807,494.81

注：在保本周期内，基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年3月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,241,261.74	2,918,873.43

注：在保本周期内，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

#### 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：本报告期内基金管理人及上年度可比区间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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年3月11日(基金合同生效日)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	101,106,244.20	148,846.17	343,245,918.67	753,447.38

#### 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
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
002127	南极电商	2017 年 6 月 29 日	重大事项停牌	12.08	2017 年 7 月 6 日	12.61	1,667,056	19,459,792.55	20,138,036.48	-

#### 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

注：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

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，基金从事上海证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额人民币 1,785,800,000 元，其中人民币 84,200,000.00 元于 2017 年 7 月 3 日到期，人民币 183,600,000.00 元于 2017 年 7 月 3 日到期，人民币 918,000,000.00 元于 2017 年 7 月 3 日到期，人民币 400,000,000.00 元于 2017 年 7 月 3 日到期，人民币 200,000,000.00 元于 2017 年 7 月 3 日到期；该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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	456,658,219.03	7.72
	其中：股票	456,658,219.03	7.72
2	固定收益投资	4,423,364,658.00	74.73
	其中：债券	4,423,364,658.00	74.73
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	878,397,348.59	14.84
7	其他各项资产	160,513,114.77	2.71
8	合计	5,918,933,340.39	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	275,286,045.42	6.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	161,234,137.13	3.99
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	20,138,036.48	0.50

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	456,658,219.03	11.29

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

### 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

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	601318	中国平安	3,250,033	161,234,137.13	3.99
2	000333	美的集团	3,500,014	150,640,602.56	3.72
3	002508	老板电器	900,038	39,133,652.24	0.97
4	002035	华帝股份	1,599,939	38,718,523.80	0.96
5	002572	索菲亚	632,024	25,912,984.00	0.64
6	000651	格力电器	500,000	20,585,000.00	0.51
7	002127	南极电商	1,667,056	20,138,036.48	0.50
8	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
9	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
10	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00

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 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 网站的年度报告正文。

## 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	000333	美的集团	121,744,004.23	2.73
2	601318	中国平安	120,900,357.56	2.72
3	002035	华帝股份	38,108,118.48	0.86
4	002508	老板电器	37,261,731.25	0.84
5	002572	索菲亚	24,274,298.10	0.55
6	002127	南极电商	21,012,321.32	0.47
7	601717	郑煤机	19,070,086.22	0.43
8	600519	贵州茅台	17,268,643.75	0.39
9	000651	格力电器	15,976,711.00	0.36
10	000049	德赛电池	14,191,449.42	0.32
11	601607	上海医药	13,755,510.17	0.31
12	000422	湖北宜化	13,709,888.00	0.31
13	300232	洲明科技	13,283,256.50	0.30
14	002241	歌尔股份	12,626,258.19	0.28
15	600741	华域汽车	12,559,590.64	0.28
16	601800	中国交建	11,443,017.00	0.26
17	002223	鱼跃医疗	11,363,314.38	0.26
18	601111	中国国航	9,111,294.47	0.20
19	600497	驰宏锌锗	6,177,000.00	0.14
20	600867	通化东宝	5,214,872.94	0.12

注：买入金额按买卖成交金额填列，不考虑相关费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300296	利亚德	42,572,544.53	0.96
2	601717	郑煤机	20,501,401.79	0.46
3	600519	贵州茅台	19,714,211.00	0.44
4	002223	鱼跃医疗	19,307,530.51	0.43

5	002241	歌尔股份	15,069,367.33	0.34
6	600741	华域汽车	13,881,255.32	0.31
7	601607	上海医药	13,738,164.00	0.31
8	000049	德赛电池	13,646,692.59	0.31
9	300232	洲明科技	13,364,132.40	0.30
10	000422	湖北宜化	12,235,358.37	0.27
11	601800	中国交建	10,794,859.32	0.24
12	601111	中国国航	9,866,049.00	0.22
13	000826	启迪桑德	9,726,181.96	0.22
14	600497	驰宏锌锗	9,244,532.00	0.21
15	600085	同仁堂	6,709,062.00	0.15
16	002236	大华股份	6,448,953.00	0.14
17	002456	欧菲光	6,383,865.58	0.14
18	601009	南京银行	6,350,192.00	0.14
19	600369	西南证券	5,465,658.50	0.12
20	000915	山大华特	5,438,906.22	0.12

注：卖出金额按买卖成交金额填列，不考虑相关费用。

### 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	550,337,805.14
卖出股票收入（成交）总额	281,857,348.87

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	208,866,800.00	5.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,838,904,858.00	70.20
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,061,000.00	0.47
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	1,356,532,000.00	33.54
9	其他	-	-

10	合计	4,423,364,658.00	109.37
----	----	------------------	--------

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	020174	17 贴现国债 18	2,000,000	196,880,000.00	4.87
2	111696872	16 杭州银行 CD119	1,500,000	145,365,000.00	3.59
3	111796666	17 南京银行 CD096	1,500,000	145,035,000.00	3.59
4	111792693	17 南京银行 CD023	1,000,000	97,850,000.00	2.42
5	111792688	17 宁波银行 CD047	1,000,000	97,840,000.00	2.42

### 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：本基金本报告期期末未持有股指期货投资。

#### 7.10.1 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货投资。



## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：报告期末本基金无国债期货持仓。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

### 7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	489,327.16
2	应收证券清算款	84,194,010.52
3	应收股利	-
4	应收利息	75,829,077.93
5	应收申购款	699.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	160,513,114.77

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002127	南极电商	20,138,036.48	0.50	重大事项停牌

## § 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
22,017	178,496.54	900,118,575.04	22.90%	3,029,839,699.21	77.10%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	50,949.05	0.00%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年3月11日）基金份额总额	4,849,549,217.33
本报告期期初基金份额总额	4,466,254,119.13
本报告期基金总申购份额	1,660,863.86
减：本报告期基金总赎回份额	537,956,708.74
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	3,929,958,274.25

注：总申购份额含转换入份额，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网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网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

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内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	
东方证券	2	827,494,110.12	99.65%	760,987.41	99.66%	-
恒泰证券	2	2,871,992.00	0.35%	2,617.20	0.34%	-
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	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

国泰君安	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	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	-	-	-	-	-
东兴证券	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	-	-	-	-	-
华泰联合证 券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	4,124,916,086.56	99.99%	54,527,927,000.00	100.00%	-	-
恒泰证券	288,405.00	0.01%	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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（上交所单元和深交所单元）

## § 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

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