

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

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 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
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.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
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.....	68

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金
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×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×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
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200120	100140
法定代表人	李文	易会满

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(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
本期加权平均净值利润率	11.82%
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)
期末可供分配利润	74,473,584.65
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
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	47.39%

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。

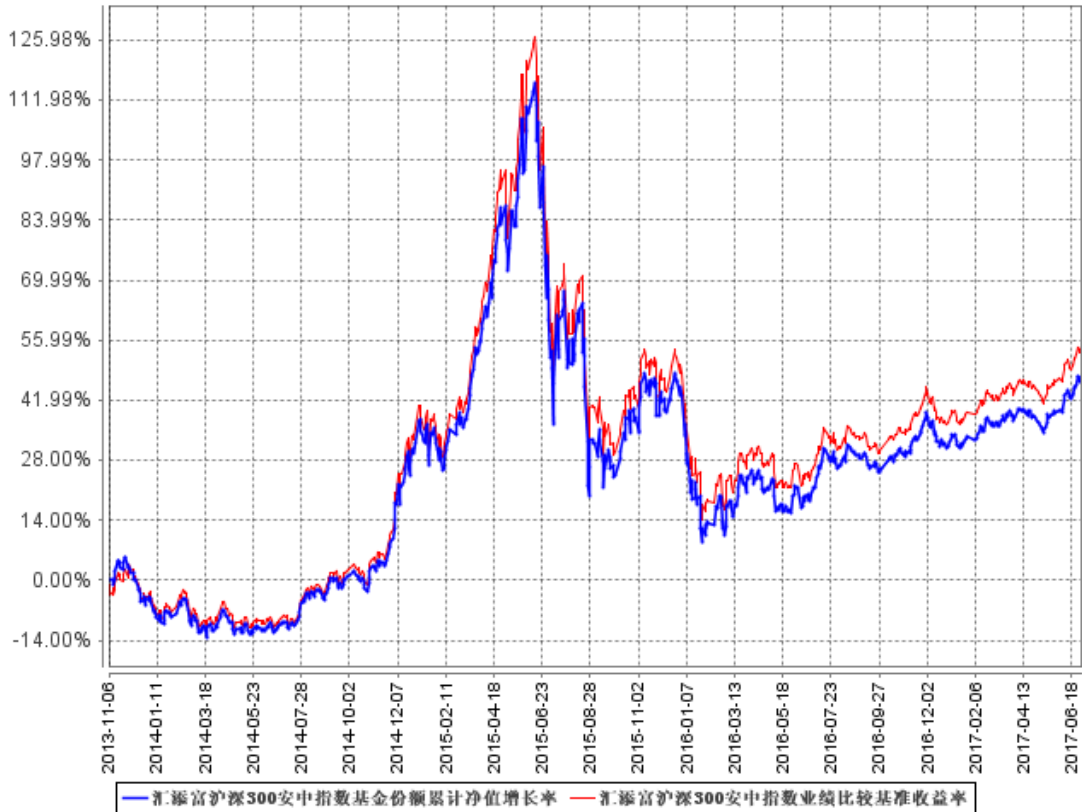
3.2 基金净值表现

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	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

	<p>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) 的基金经理，指数与量化投资部副总监。</p>			<p>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，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。</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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖开放式基金、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	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	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	6.4.7.2	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,478,930.03	5,383,739.20
应收利息	6.4.7.5	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	6.4.7.6	-	-
资产总计		337,620,203.62	279,143,671.72
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	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	6.4.7.7	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	6.4.7.8	318,739.17	420,324.37
负债合计		753,950.00	4,718,713.11
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	228,555,140.46	209,201,323.44
未分配利润	6.4.7.10	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：1、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。

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 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	附注号	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
一、收入		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	6.4.7.11	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	6.4.7.12	11,562,458.82	-25,389,338.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	715.55	47,281.74
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,988,923.27	1,534,449.77
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	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)	6.4.7.18	34,300.92	48,813.86
减：二、费用		2,069,574.44	2,116,982.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	741,511.44	596,821.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	148,302.30	119,364.15
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	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	6.4.7.20	268,769.50	284,147.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		35,487,964.88	-42,456,119.27

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富沪深 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	228,555,140.46	108,311,113.16	336,866,253.62

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
金净值)			
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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
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×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×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。

本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	22,500,738.46
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	22,500,738.46

注：本基金未投资于定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	290,723,977.44	312,979,633.95	22,255,656.51
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	290,723,977.44	312,979,633.95	22,255,656.51

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,601.50
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	145.44
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	13.68
合计	3,760.62

注：“其他”指应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	233,747.00
银行间市场应付交易费用	-
合计	233,747.00

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	137.67
预提信息披露费	238,848.72
预提审计费	29,752.78
其他应付款	50,000.00
合计	318,739.17

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	209,201,323.44	209,201,323.44
本期申购	42,582,786.86	42,582,786.86
本期赎回(以“-”号填列)	-23,228,969.84	-23,228,969.84
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	228,555,140.46	228,555,140.46

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	57,054,884.68	8,168,750.49	65,223,635.17
本期利润	11,591,369.25	23,896,595.63	35,487,964.88
本期基金份额交易产生的变动数	5,827,330.72	1,772,182.39	7,599,513.11
其中：基金申购款	12,627,871.83	3,672,358.77	16,300,230.60
基金赎回款	-6,800,541.11	-1,900,176.38	-8,700,717.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,473,584.65	33,837,528.51	108,311,113.16

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	68,214.19
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	5,143.06
其他	1,172.63
合计	74,529.88

注：“其他”为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	295,071,273.18
减：卖出股票成本总额	283,508,814.36
买卖股票差价收入	11,562,458.82

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债	715.55

券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	715.55

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	58,730.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	58,000.00
减：应收利息总额	15.25
买卖债券差价收入	715.55

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本期未投资衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,988,923.27
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,988,923.27

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	23,896,595.63
——股票投资	23,896,595.63
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	23,896,595.63

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	34,300.92
合计	34,300.92

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	910,991.20
银行间市场交易费用	-
合计	910,991.20

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	138,848.72

银行费用	168.00
指数使用费	100,000.00
合计	268,769.50

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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、公休假期等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	148,302.30	119,364.15

的托管费		
------	--	--

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末和上年度末未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金在本期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600050	中国联通	2017 年 4 月	重大	6.85	2017 年 8 月	8.22	1,663,468	10,880,365.69	11,394,755.80	-

		月 5 日	事项停牌		月 21 日					
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	6.21	-	-	124,100	870,274.19	770,661.00	-

			重组停牌								
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	10.57	-	-	33,330	374,754.29	352,298.10	-	

			重组停牌							
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	中信重工	2017年4月19日	重大事项停牌	5.54	2017年7月26日	5.26	24,300	136,047.62	134,622.00	-
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	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行，另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、存出保证金、部分交易性金融资产及部分应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	22,500,738.46	-	-	-	-	-	22,500,738.46
结算备付金	358,924.73	-	-	-	-	-	358,924.73
存出保证金	33,763.50	-	-	-	-	-	33,763.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	312,979,633.95	312,979,633.95
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,478,930.03	1,478,930.03
应收利息	-	-	-	-	-	3,760.62	3,760.62
应收申购款	169,018.41	-	-	-	-	95,433.92	264,452.33
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	23,062,445.10	-	-	-	-	314,557,758.52	337,620,203.62
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	41,380.91	41,380.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	133,402.41	133,402.41
应付托管费	-	-	-	-	-	26,680.51	26,680.51
应付交易费用	-	-	-	-	-	233,747.00	233,747.00
其他负债	-	-	-	-	-	318,739.17	318,739.17
负债总计	-	-	-	-	-	753,950.00	753,950.00
利率敏感度缺口	23,062,445.10	-	-	-	-	-313,803,808.52	336,866,253.62
上年度末 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
资产							
银行存款	17,672,425.79	-	-	-	-	-	17,672,425.79
结算备付金	606,444.38	-	-	-	-	-	606,444.38
存出保证金	43,744.99	-	-	-	-	-	43,744.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	255,262,004.29	255,262,004.29
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,383,739.20	5,383,739.20
应收利息	-	-	-	-	-	3,857.76	3,857.76
应收申购款	14,207.93	-	-	-	-	157,247.38	171,455.31
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	18,336,823.09	-	-	-	-	260,806,848.63	279,143,671.72

负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,641,973.88	3,641,973.88
应付赎回款	-	-	-	-	-	100,361.92	100,361.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	118,443.36	118,443.36
应付托管费	-	-	-	-	-	23,688.67	23,688.67
应付交易费用	-	-	-	-	-	413,920.91	413,920.91
其他负债	-	-	-	-	-	420,324.37	420,324.37
负债总计	-	-	-	-	-	4,718,713.11	4,718,713.11
利率敏感度缺口	18,336,823.09	-	-	-	-	-256,088,135.52	274,424,958.61

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期期末计息资产仅包括银行存款及应收申购款，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，因而在本基金本期期末未持有其他资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	312,979,633.95	92.91	255,262,004.29	93.02
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	312,979,633.95	92.91	255,262,004.29	93.02

注：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%。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	沪深 300 安中动态策略指数 上涨 5%	16,780,054.92	14,101,309.83
沪深 300 安中动态策略指数 下跌 5%	-16,780,054.92	-14,101,309.83	

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	312,979,633.95	92.70
	其中：股票	312,979,633.95	92.70
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	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（元）	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（元）	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所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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
11	002304	洋河股份	61,378	5,328,224.18	1.58
12	600023	浙能电力	956,811	5,224,188.06	1.55
13	600674	川投能源	513,691	5,044,445.62	1.50
14	601088	中国神华	174,911	3,898,766.19	1.16
15	000651	格力电器	91,515	3,767,672.55	1.12
16	000333	美的集团	87,097	3,748,654.88	1.11
17	600276	恒瑞医药	73,585	3,722,665.15	1.11
18	601857	中国石油	431,970	3,321,849.30	0.99
19	002415	海康威视	90,493	2,922,923.90	0.87
20	601318	中国平安	58,588	2,906,550.68	0.86
21	002252	上海莱士	139,370	2,836,179.50	0.84
22	600518	康美药业	127,899	2,780,524.26	0.83
23	600485	信威集团	173,842	2,536,354.78	0.75
24	000725	京东方 A	603,038	2,508,638.08	0.74
25	002465	海格通信	230,448	2,475,011.52	0.73
26	600690	青岛海尔	150,528	2,265,446.40	0.67
27	000538	云南白药	23,035	2,161,834.75	0.64
28	600019	宝钢股份	311,274	2,088,648.54	0.62
29	600104	上汽集团	67,182	2,086,001.10	0.62
30	002024	苏宁云商	184,759	2,078,538.75	0.62
31	601668	中国建筑	213,067	2,062,488.56	0.61
32	002450	康得新	90,375	2,035,245.00	0.60
33	600741	华域汽车	77,599	1,880,999.76	0.56
34	000568	泸州老窖	36,599	1,851,177.42	0.55

35	600660	福耀玻璃	70,615	1,838,814.60	0.55
36	600008	首创股份	272,462	1,792,799.96	0.53
37	600498	烽火通信	69,700	1,766,895.00	0.52
38	601225	陕西煤业	245,166	1,733,323.62	0.51
39	000423	东阿阿胶	23,058	1,657,639.62	0.49
40	600585	海螺水泥	72,525	1,648,493.25	0.49
41	600157	永泰能源	450,415	1,607,981.55	0.48
42	000069	华侨城 A	159,187	1,601,421.22	0.48
43	600066	宇通客车	66,330	1,457,270.10	0.43
44	601607	上海医药	49,959	1,442,815.92	0.43
45	601766	中国中车	142,056	1,437,606.72	0.43
46	600637	东方明珠	65,979	1,429,764.93	0.42
47	601888	中国国旅	47,138	1,420,739.32	0.42
48	000625	长安汽车	96,338	1,389,193.96	0.41
49	600196	复星医药	44,593	1,381,937.07	0.41
50	600309	万华化学	48,175	1,379,732.00	0.41
51	002594	比亚迪	27,247	1,360,987.65	0.40
52	600036	招商银行	55,389	1,324,350.99	0.39
53	600688	上海石化	199,841	1,320,949.01	0.39
54	601899	紫金矿业	381,675	1,309,145.25	0.39
55	601933	永辉超市	183,692	1,300,539.36	0.39
56	000839	中信国安	129,400	1,292,706.00	0.38
57	600583	海油工程	202,837	1,265,702.88	0.38
58	000983	西山煤电	141,237	1,238,648.49	0.37
59	002466	天齐锂业	22,400	1,217,440.00	0.36
60	002739	万达电影	23,800	1,213,086.00	0.36
61	300072	三聚环保	32,700	1,211,535.00	0.36
62	600021	上海电力	97,300	1,176,357.00	0.35
63	600535	天士力	28,229	1,172,632.66	0.35
64	600256	广汇能源	283,166	1,172,307.24	0.35
65	601166	兴业银行	67,663	1,140,798.18	0.34
66	000895	双汇发展	46,742	1,110,122.50	0.33
67	601988	中国银行	297,934	1,102,355.80	0.33
68	600177	雅戈尔	108,020	1,093,162.40	0.32
69	600703	三安光电	55,326	1,089,922.20	0.32
70	600010	包钢股份	496,788	1,087,965.72	0.32
71	601600	中国铝业	239,738	1,083,615.76	0.32
72	000963	华东医药	21,724	1,079,682.80	0.32
73	600016	民生银行	129,413	1,063,774.86	0.32

74	000793	华闻传媒	98,015	991,911.80	0.29
75	002230	科大讯飞	24,455	975,754.50	0.29
76	601390	中国中铁	111,170	963,843.90	0.29
77	002241	歌尔股份	49,898	962,033.44	0.29
78	000002	万科 A	38,323	956,925.31	0.28
79	002508	老板电器	21,800	947,864.00	0.28
80	000623	吉林敖东	41,336	946,181.04	0.28
81	601328	交通银行	152,593	939,972.88	0.28
82	300104	乐视网	30,365	931,598.20	0.28
83	600111	北方稀土	80,108	907,623.64	0.27
84	002456	欧菲光	49,787	904,629.79	0.27
85	002007	华兰生物	24,724	902,426.00	0.27
86	002236	大华股份	38,507	878,344.67	0.26
87	600085	同仁堂	24,444	854,562.24	0.25
88	000876	新希望	100,636	827,227.92	0.25
89	601186	中国铁建	68,166	820,036.98	0.24
90	600297	广汇汽车	108,890	819,941.70	0.24
91	600352	浙江龙盛	84,285	803,236.05	0.24
92	601633	长城汽车	60,439	803,234.31	0.24
93	002008	大族激光	23,172	802,678.08	0.24
94	600547	山东黄金	27,445	793,983.85	0.24
95	002027	分众传媒	57,600	792,576.00	0.24
96	300059	东方财富	65,503	787,346.06	0.23
97	600000	浦发银行	61,345	776,014.25	0.23
98	601989	中国重工	124,100	770,661.00	0.23
99	601288	农业银行	218,593	769,447.36	0.23
100	601006	大秦铁路	90,993	763,431.27	0.23
101	600030	中信证券	44,704	760,862.08	0.23
102	600682	南京新百	20,100	741,690.00	0.22
103	603993	洛阳钼业	145,776	737,626.56	0.22
104	600332	白云山	25,351	736,193.04	0.22
105	002044	美年健康	41,800	710,600.00	0.21
106	600837	海通证券	46,195	685,995.75	0.20
107	002475	立讯精密	23,228	679,186.72	0.20
108	600100	同方股份	47,487	670,516.44	0.20
109	000630	铜陵有色	233,610	663,452.40	0.20
110	000709	河钢股份	158,045	662,208.55	0.20
111	600436	片仔癀	10,800	659,232.00	0.20
112	600373	中文传媒	27,563	648,006.13	0.19

113	601992	金隅股份	99,300	642,471.00	0.19
114	600489	中金黄金	64,033	642,250.99	0.19
115	000060	中金岭南	57,056	639,027.20	0.19
116	000559	万向钱潮	60,101	638,272.62	0.19
117	601169	北京银行	68,458	627,759.86	0.19
118	002385	大北农	99,670	626,924.30	0.19
119	600827	百联股份	38,463	625,023.75	0.19
120	601601	中国太保	18,355	621,683.85	0.18
121	600271	航天信息	29,862	616,351.68	0.18
122	600570	恒生电子	13,139	613,328.52	0.18
123	600060	海信电器	39,663	601,687.71	0.18
124	000413	东旭光电	52,976	594,390.72	0.18
125	601718	际华集团	67,000	588,930.00	0.17
126	600089	特变电工	56,557	584,233.81	0.17
127	601669	中国电建	71,243	564,244.56	0.17
128	600009	上海机场	15,066	562,112.46	0.17
129	600871	石化油服	167,500	559,450.00	0.17
130	600362	江西铜业	32,601	549,652.86	0.16
131	600804	鹏博士	30,949	549,344.75	0.16
132	300144	宋城演艺	26,300	548,881.00	0.16
133	300027	华谊兄弟	67,495	546,034.55	0.16
134	002065	东华软件	24,674	537,646.46	0.16
135	601211	国泰君安	26,100	535,311.00	0.16
136	300070	碧水源	28,529	532,065.85	0.16
137	600037	歌华有线	35,600	518,336.00	0.15
138	600977	中国电影	26,800	501,696.00	0.15
139	002602	世纪华通	13,800	500,388.00	0.15
140	601216	君正集团	101,434	496,012.26	0.15
141	600737	中粮糖业	52,000	490,880.00	0.15
142	000100	TCL 集团	142,965	490,369.95	0.15
143	600031	三一重工	60,285	490,117.05	0.15
144	000503	海虹控股	19,639	489,600.27	0.15
145	000338	潍柴动力	37,030	488,796.00	0.15
146	600068	葛洲坝	43,250	486,130.00	0.14
147	002131	利欧股份	147,400	484,946.00	0.14
148	600029	南方航空	55,130	479,631.00	0.14
149	002714	牧原股份	17,600	479,072.00	0.14
150	002411	必康股份	16,500	477,180.00	0.14
151	000792	盐湖股份	45,654	477,084.30	0.14

152	300017	网宿科技	39,259	473,856.13	0.14
153	002292	奥飞娱乐	27,652	467,318.80	0.14
154	000001	平安银行	49,460	464,429.40	0.14
155	600188	兖州煤业	37,538	459,465.12	0.14
156	002470	金正大	60,928	458,787.84	0.14
157	000156	华数传媒	29,706	442,916.46	0.13
158	600048	保利地产	42,592	424,642.24	0.13
159	601618	中国中冶	83,721	419,442.21	0.12
160	000917	电广传媒	37,096	419,184.80	0.12
161	300124	汇川技术	16,169	412,956.26	0.12
162	000768	中航飞机	22,031	406,251.64	0.12
163	300133	华策影视	36,114	404,476.80	0.12
164	300315	掌趣科技	49,200	401,472.00	0.12
165	601727	上海电气	51,791	392,057.87	0.12
166	002202	金风科技	25,022	387,090.34	0.11
167	600718	东软集团	24,773	385,220.15	0.11
168	300033	同花顺	6,100	379,481.00	0.11
169	601818	光大银行	93,610	379,120.50	0.11
170	002424	贵州百灵	20,100	379,086.00	0.11
171	600666	奥瑞德	21,280	370,272.00	0.11
172	601800	中国交建	22,975	365,072.75	0.11
173	600549	厦门钨业	16,900	363,181.00	0.11
174	002195	二三四五	50,090	358,143.50	0.11
175	600074	保千里	27,900	357,399.00	0.11
176	600588	用友网络	20,781	355,770.72	0.11
177	601018	宁波港	62,889	355,322.85	0.11
178	600739	辽宁成大	19,584	353,099.52	0.10
179	600959	江苏有线	33,330	352,298.10	0.10
180	601688	华泰证券	19,658	351,878.20	0.10
181	600893	航发动力	12,807	349,631.10	0.10
182	600015	华夏银行	37,910	349,530.20	0.10
183	002299	圣农发展	23,100	343,497.00	0.10
184	300024	机器人	17,458	340,431.00	0.10
185	600221	海航控股	105,517	339,764.74	0.10
186	600018	上港集团	52,628	333,661.52	0.10
187	600406	国电南瑞	18,770	331,290.50	0.10
188	601111	中国国航	33,265	324,333.75	0.10
189	600115	东方航空	47,511	323,074.80	0.10
190	000157	中联重科	70,815	317,959.35	0.09

191	600415	小商品城	43,820	317,256.80	0.09
192	000776	广发证券	18,028	310,983.00	0.09
193	001979	招商蛇口	14,548	310,745.28	0.09
194	600153	建发股份	23,866	308,587.38	0.09
195	002174	游族网络	9,700	308,072.00	0.09
196	601163	三角轮胎	11,700	307,710.00	0.09
197	600820	隧道股份	30,400	307,040.00	0.09
198	601118	海南橡胶	52,206	296,530.08	0.09
199	000826	启迪桑德	8,443	296,518.16	0.09
200	002310	东方园林	17,700	295,944.00	0.09
201	601919	中远海控	54,914	293,789.90	0.09
202	000977	浪潮信息	16,900	292,708.00	0.09
203	000009	中国宝安	36,179	292,688.11	0.09
204	002129	中环股份	35,287	291,823.49	0.09
205	300168	万达信息	20,000	291,000.00	0.09
206	002081	金螳螂	26,282	288,576.36	0.09
207	002152	广电运通	34,550	287,110.50	0.09
208	002049	紫光国芯	9,300	286,626.00	0.09
209	601628	中国人寿	10,551	284,665.98	0.08
210	601966	玲珑轮胎	12,500	280,375.00	0.08
211	601958	金钼股份	39,026	279,816.42	0.08
212	002426	胜利精密	36,100	277,248.00	0.08
213	600118	中国卫星	9,940	276,729.60	0.08
214	600170	上海建工	71,642	273,672.44	0.08
215	601336	新华保险	5,324	273,653.60	0.08
216	000425	徐工机械	70,283	263,561.25	0.08
217	600150	中国船舶	11,506	263,142.22	0.08
218	000938	紫光股份	4,300	262,816.00	0.08
219	601333	广深铁路	56,861	257,011.72	0.08
220	600446	金证股份	14,600	256,668.00	0.08
221	601939	建设银行	41,274	253,835.10	0.08
222	002074	国轩高科	8,000	252,400.00	0.07
223	601901	方正证券	25,400	252,222.00	0.07
224	601009	南京银行	22,254	249,467.34	0.07
225	600999	招商证券	14,456	248,932.32	0.07
226	002558	巨人网络	5,200	240,344.00	0.07
227	002555	三七互娱	9,100	232,687.00	0.07
228	002142	宁波银行	11,787	227,489.10	0.07
229	002153	石基信息	9,836	223,572.28	0.07

230	601377	兴业证券	29,926	222,350.18	0.07
231	600704	物产中大	30,000	218,700.00	0.06
232	002183	怡亚通	25,300	218,339.00	0.06
233	000166	申万宏源	38,830	217,448.00	0.06
234	000415	渤海金控	32,000	215,360.00	0.06
235	002736	国信证券	16,120	213,590.00	0.06
236	600340	华夏幸福	6,261	210,244.38	0.06
237	603858	步长制药	2,900	207,756.00	0.06
238	000783	长江证券	21,842	206,843.74	0.06
239	600038	中直股份	4,378	200,381.06	0.06
240	601866	中远海发	55,308	199,108.80	0.06
241	601788	光大证券	12,908	192,716.44	0.06
242	601099	太平洋	45,705	183,734.10	0.05
243	300251	光线传媒	22,114	181,113.66	0.05
244	300085	银之杰	9,500	175,750.00	0.05
245	601555	东吴证券	15,585	175,019.55	0.05
246	600383	金地集团	15,130	173,541.10	0.05
247	600705	中航资本	30,638	173,104.70	0.05
248	002673	西部证券	12,080	171,777.60	0.05
249	600816	安信信托	12,520	170,146.80	0.05
250	600109	国金证券	14,402	168,791.44	0.05
251	600685	中船防务	6,100	167,018.00	0.05
252	601872	招商轮船	32,000	165,120.00	0.05
253	000738	航发控制	8,400	164,388.00	0.05
254	600372	中航电子	9,376	162,861.12	0.05
255	600482	中国动力	6,400	161,856.00	0.05
256	601877	正泰电器	8,000	160,720.00	0.05
257	000728	国元证券	12,788	156,269.36	0.05
258	601021	春秋航空	4,610	155,034.30	0.05
259	600606	绿地控股	19,800	154,836.00	0.05
260	000555	神州信息	9,200	153,640.00	0.05
261	000540	中天金融	20,500	142,475.00	0.04
262	601998	中信银行	22,009	138,436.61	0.04
263	601198	东兴证券	8,000	137,920.00	0.04
264	601608	中信重工	24,300	134,622.00	0.04
265	000061	农产品	14,670	132,910.20	0.04
266	600663	陆家嘴	5,507	130,185.48	0.04
267	000008	神州高铁	17,700	128,856.00	0.04
268	600208	新湖中宝	28,633	128,848.50	0.04

269	601611	中国核建	10,700	128,079.00	0.04
270	601127	小康股份	6,400	127,680.00	0.04
271	600061	国投安信	8,200	127,510.00	0.04
272	601155	新城控股	6,700	124,218.00	0.04
273	000750	国海证券	22,372	123,046.00	0.04
274	600369	西南证券	21,658	121,501.38	0.04
275	002146	荣盛发展	11,696	115,439.52	0.03
276	000402	金融街	9,634	112,910.48	0.03
277	000686	东北证券	11,136	111,916.80	0.03
278	600649	城投控股	10,309	108,347.59	0.03
279	600895	张江高科	6,400	108,032.00	0.03
280	002500	山西证券	11,030	105,667.40	0.03
281	600376	首开股份	8,700	99,528.00	0.03
282	000627	天茂集团	11,600	93,728.00	0.03
283	000671	阳光城	14,900	86,718.00	0.03
284	000718	苏宁环球	14,200	83,212.00	0.02
285	002797	第一创业	5,940	54,707.40	0.02
286	000959	首钢股份	6,000	41,940.00	0.01
287	300015	爱尔眼科	94	2,186.44	0.00
288	002085	万丰奥威	80	1,556.00	0.00
289	600648	外高桥	74	1,370.48	0.00
290	300146	汤臣倍健	78	1,071.72	0.00
291	603000	人民网	80	1,053.60	0.00
292	000800	一汽轿车	91	925.47	0.00
293	600875	东方电气	83	795.14	0.00
294	601928	凤凰传媒	81	790.56	0.00
295	000039	中集集团	40	721.20	0.00
296	300058	蓝色光标	80	625.60	0.00
297	603885	吉祥航空	40	607.20	0.00
298	600873	梅花生物	94	532.98	0.00
299	300002	神州泰岳	51	425.34	0.00
300	000027	深圳能源	31	208.63	0.00
301	600783	鲁信创投	11	187.33	0.00
302	600839	四川长虹	32	115.84	0.00
303	601258	庞大集团	22	61.60	0.00
304	600252	中恒集团	11	44.44	0.00
305	000778	新兴铸管	5	33.50	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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
6	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
7	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
8	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
9	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
10	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
11	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
12	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
13	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
14	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
15	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
16	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
17	002880	卫光生物	98	7,418.60	0.00
18	603380	易德龙	98	2,670.50	0.00
19	300663	科蓝软件	92	2,192.36	0.00
20	300662	科锐国际	56	1,415.12	0.00
21	601878	浙商证券	49	833.49	0.00
22	603879	永悦科技	27	623.70	0.00
23	603316	诚邦股份	24	510.24	0.00
24	603536	惠发股份	8	191.60	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	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所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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	2.85	重大资产重组停牌
2	600050	中国联通	11,394,755.80	3.38	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%

8.2 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	80,270.14	0.0351%

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（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

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		2609,581,219.42	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）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2016 年年度资产净值的公告	公司网站	2017 年 1 月 3 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加奕丰金融为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 1 月 11 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加凤凰金信为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 1 月 13 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告（国际医学、国电南瑞、时代出版、中源协和）	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 1 月 17 日
5	汇添富旗下公募基金 2016 年第 4 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017 年 1 月 19 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关	中证报, 证券时报,	2017 年 2 月 21 日

	于调整旗下部分基金通过盈米财富申购金额下限的公告	上证报, 公司网站	
7	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	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 2 月 23 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加联储证券为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 2 月 24 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加泉州银行为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 2 月 27 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加苏宁基金为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 2 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加龙江银行为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 7 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与财通证券申购费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 16 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在财通证券开通定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 16 日
14	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定投费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 20 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加肯特瑞财富为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 23 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加申万宏源开展的申购基金费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 23 日
17	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加申万宏源西部开展的申购基金费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 23 日
18	汇添富旗下公募基金 2016 年年度报告及摘要	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017 年 3 月 29 日

19	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行申购基金费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 30 日
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加首创证券开展的申购费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 11 日
21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加首创证券开展的定投费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 11 日
22	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中信建投证券开展的定投费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 14 日
23	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加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	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 22 日
24	汇添富旗下公募基金 2017 年一季报	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017 年 4 月 24 日
25	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告(当代明诚、中国联通、荣之联)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 25 日
26	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下基金场外申购、定投单笔金额下限及场外最低赎回、转换、保留份额的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 26 日
27	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中银国际证券为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 5 月 3 日
28	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在中银国际证券开通定投业务的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 5 月 5 日
29	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在中银国际证券开通转换业务的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 5 月 5 日
30	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 5 月 24 日
31	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 5 月 27 日

32	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金更新招募说明书 (2017 年第 1 号)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 6 月 16 日
33	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加长量基金开展的定投基金费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 6 月 17 日

§ 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、转换运作方式或与其他基金合并。

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

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 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 8 月 26 日