

# 汇添富社会责任混合型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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**

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	58
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>61</b>
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.....	61

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录 .....	61
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富社会责任混合型证券投资基金
基金简称	汇添富社会责任混合
基金主代码	470028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 29 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,819,892,566.75 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	精选积极履行社会责任，并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司，谋求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘积极履行社会责任的优质上市公司，以谋求基金资产稳健增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80% + 中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	林葛
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-68121816

注册地址	上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座
邮政编码	200120	100031
法定代表人	李文	周慕冰

## 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	-320,823,251.78
本期利润	32,840,665.68
加权平均基金份额本期利润	0.0175
本期加权平均净值利润率	1.14%
本期基金份额净值增长率	1.17%
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	492,042,932.88
期末可供分配基金份额利润	0.2704
期末基金资产净值	2,839,959,805.39
期末基金份额净值	1.561
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	56.10%

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

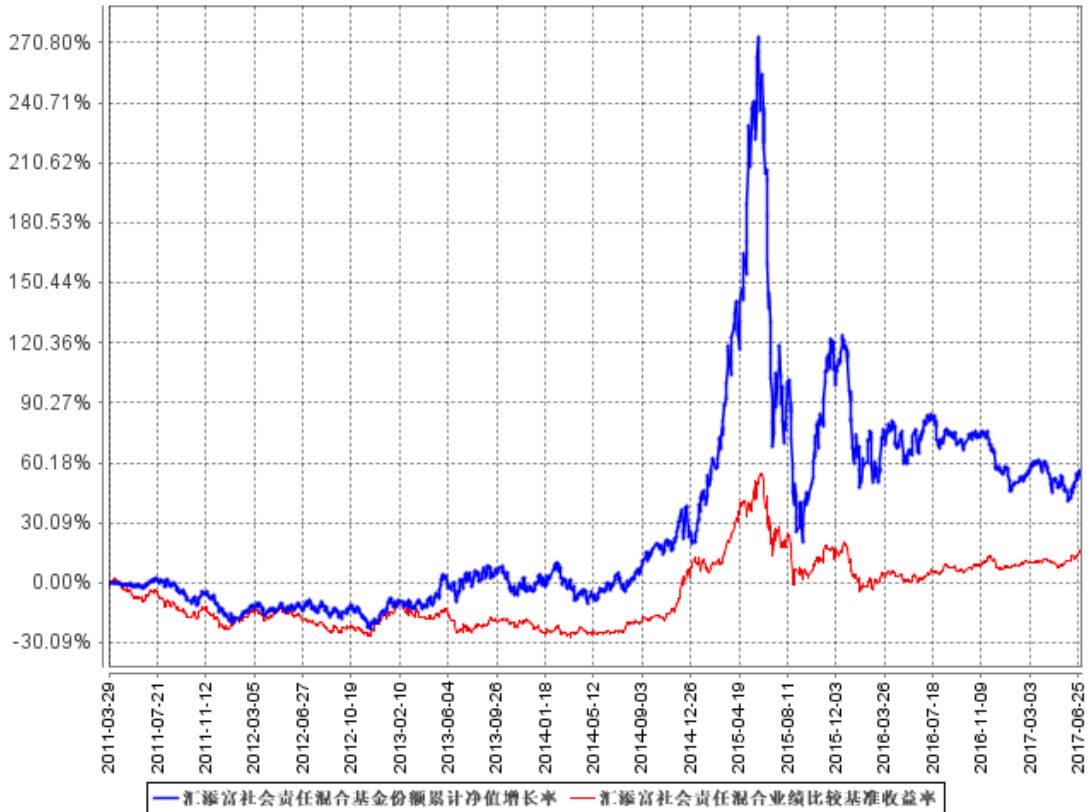
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.36%	1.30%	4.22%	0.54%	3.14%	0.76%
过去三个月	-0.19%	1.26%	4.90%	0.50%	-5.09%	0.76%
过去六个月	1.17%	1.09%	8.52%	0.46%	-7.35%	0.63%
过去一年	-13.28%	1.06%	12.94%	0.54%	-26.22%	0.52%
过去三年	53.49%	2.51%	59.95%	1.40%	-6.46%	1.11%
自基金合同生效日起至 今	56.10%	1.97%	18.78%	1.22%	37.32%	0.75%



### 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

汇添富社会责任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（2011年3月29日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5号文批准，于2005年2月3日正式成立，注册资本为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、汇添富收益快线货币市场基金、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		
欧阳沁春	汇添富社会责任混合基金、汇添富移动互联股票基金、汇添富全球移动互联混合基金的基金经	2011年3月29日	-	16年	国籍：中国。学历：卫生部武汉生物制品研究所医学硕士、中欧国际工商学院工商管理硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任卫生部武汉生物制品研究所助理研究员、中国网络（百慕大）有限公司项目经理、大成基金管理有限公司行业研究员、国联安基金管理有限公司行业研究员，2006年9月加入汇

	理, 移动互联网行业投资总监。			添富基金管理股份有限公司, 现任移动互联网行业投资总监, 2007 年 6 月 18 日至 2012 年 3 月 2 日任汇添富均衡增长混合基金的基金经理, 2011 年 3 月 29 日至今任汇添富社会责任混合基金的基金经理, 2014 年 8 月 26 日至今任汇添富移动互联股票基金的基金经理, 2017 年 1 月 25 日至今任汇添富全球移动互联混合基金的基金经理。
--	-----------------	--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护, 根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规, 借鉴国际经验, 建立了健全、有效的公平交易制度体系, 形成涵盖开放式基金、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 年上半年的 A 股市场市场趋势继续以大幅分化：上证指数 v 型反转，上涨 2.86%，深圳成指上涨 3.46%，创业板指下跌 7.34%。宏观经济角度方面：美国经济数据显示复苏仍在进行中，且 6 月份如期加息，全球负利率政策基本已经到了拐点期，货币政策收紧是中长期趋势；国内经济保持平稳增长，经济的韧性远超市场预期。在金融监管持续推进下，政策因素对于市场的扰动可能持续存在，但是大扰动的风险在下降。风格资产继续强劲分化，低估值蓝筹积极及各个行业龙头企业表现相对出色，高估值股票依然在挤压泡沫中，继续下跌。

本基金投资依旧遵循行业相对均衡配置，个股适度集中的原则。在整体经济逐步放缓的大背景下，我们一直试图寻找业绩中高增长点，估值相对合理或者低估的股票进行重点投资。在行业配置方面：我们新增了部分大金融行业的投资；我们认为全球的新能源产业方兴未艾，是未来 5-8 年的投资机遇，我们增加了新能源产业链方面特别是上游资源和具备全球竞争力的锂电设备的个股配置，使得组合的配置更加均衡。我们也加大了符合中国消费升级产业的个股投资。

#### 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 1.5610 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.17%，业绩比较基准收益率为 8.52%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，经济已经复苏，目前数据显示经济处于比较健康和良性的状态，我们判断经济继续稳步回升。基建投资和部分城区的货币化棚户改造投资成为经济的拉动力，外需也显示了不错复苏动能。新兴消费、消费的多元化是经济增长的强劲推动力。国内货币中性但是金融市场处于降低杠杠与控制风险过程中，总体而言，2017 年下半年市场大概率是震荡向上的，但是

空间幅度不会太大，但是结构性机会层出不穷

本基金在下期投资中继续维持行业相对均衡、个股适度集中的投资原则，综合判断行业空间、成长确定性和个股的行业地位、竞争力与企业家素质和领导力。主要投资符合社会责任契约的上市公司：（1）契合转型经济发展新方向的中长期主题：环保新能源、传媒移动互联网等行业，（2）加大符合消费升级和消费转移的稳定增长类行业的配置。（3）阶段性把握由于节省环保供给侧收缩等原因导致产能出现瓶颈而需求出现稳定增长的行业性投资机会。

#### 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、产品创新部、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于该次收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

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



## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富社会责任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	附注号	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	6.4.7.1	165,766,405.64	173,418,049.17
结算备付金		4,847,722.30	6,681,245.69
存出保证金		1,244,965.80	2,831,948.81
交易性金融资产	6.4.7.2	2,668,284,158.87	2,809,099,637.15
其中：股票投资		2,668,202,218.17	2,809,011,145.23
基金投资		-	-
债券投资		81,940.70	88,491.92
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		11,485,782.99	-
应收利息	6.4.7.5	40,434.84	44,012.78
应收股利		-	-
应收申购款		571,105.15	989,027.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,852,240,575.59	2,993,063,920.68
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	3,980,772.29
应付赎回款		4,326,298.00	3,306,300.43
应付管理人报酬		3,383,159.45	3,978,197.88
应付托管费		563,859.91	663,032.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,705,661.37	4,687,018.23

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	301,791.47	421,093.35
负债合计		12,280,770.20	17,036,415.14
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,819,892,566.75	1,929,274,480.01
未分配利润	6.4.7.10	1,020,067,238.64	1,046,753,025.53
所有者权益合计		2,839,959,805.39	2,976,027,505.54
负债和所有者权益总计		2,852,240,575.59	2,993,063,920.68

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.561 元，基金份额总额 1,819,892,566.75 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：汇添富社会责任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	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
<b>一、收入</b>		72,904,136.04	-655,321,155.57
1.利息收入		982,817.73	2,661,508.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	982,623.38	2,560,646.78
债券利息收入		194.35	55.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	100,806.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-282,084,353.20	-637,477,402.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-291,903,330.46	-642,637,995.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
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	9,818,977.26	5,160,593.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	353,663,917.46	-23,408,907.12
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	341,754.05	2,903,644.75
<b>减：二、费用</b>		40,063,470.36	58,362,380.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	21,387,712.60	28,217,605.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,564,618.79	4,702,934.12
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	14,893,126.72	25,208,960.89
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	218,012.25	232,880.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		32,840,665.68	-713,683,535.80

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：汇添富社会责任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）	1,929,274,480.01	1,046,753,025.53	2,976,027,505.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,840,665.68	32,840,665.68
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）	-109,381,913.26	-59,526,452.57	-168,908,365.83
其中：1.基金申购款	166,222,551.32	89,257,743.48	255,480,294.80
2.基金赎回款	-275,604,464.58	-148,784,196.05	-424,388,660.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,819,892,566.75	1,020,067,238.64	2,839,959,805.39

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
一、期初所有者权益(基金净值)	2,284,592,313.28	2,548,234,398.59	4,832,826,711.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-713,683,535.80	-713,683,535.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-162,769,094.11	-137,067,421.40	-299,836,515.51
其中：1.基金申购款	1,213,546,352.42	839,765,162.91	2,053,311,515.33
2.基金赎回款	-1,376,315,446.53	-976,832,584.31	-2,353,148,030.84
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)	2,121,823,219.17	1,697,483,441.39	3,819,306,660.56

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

汇添富社会责任混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），原汇添富社会责任股票型证券投资基金，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[2010]1887号文《关于核准汇添富社会责任股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开发行募集，基金合同于 2011 年 3 月 29 日正式生效，首次设立募集规模为 5,622,650,211.18 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人、注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据中国证券监督管理委员会于 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，汇添富基金管理股份有限公司决定自 2015 年 8 月 5 日起将本基金变更为混合基金，并相应修改本基金的《基金合同》。

本基金精选积极履行社会责任，并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司，谋求基金资产的稳健增值。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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80% + 中证全债指数收益率×20%

#### 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〉》及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 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 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。

#### 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	165,766,405.64
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	165,766,405.64

注：本基金本期末未投资于定期存款。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,654,142,322.70	2,668,202,218.17	14,059,895.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	80,000.00	81,940.70
	银行间市场	-	-
	合计	80,000.00	81,940.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,654,222,322.70	2,668,284,158.87	14,061,836.17

##### 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	37,789.16
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	1,963.35
应收债券利息	129.76
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	48.30
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	504.27
合计	40,434.84

注：表中“其他”为应收存出保证金利息

**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	3,705,661.37
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,705,661.37

**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	8,394.78
应付信息披露费	248,765.71
应付审计费	44,630.98
合计	301,791.47

#### 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	1,929,274,480.01	1,929,274,480.01
本期申购	166,222,551.32	166,222,551.32
本期赎回(以“-”号填列)	-275,604,464.58	-275,604,464.58
- 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	1,819,892,566.75	1,819,892,566.75

注：本期申购中包含红利再投、转换入份额，本期赎回中包含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	848,124,800.70	198,628,224.83	1,046,753,025.53
本期利润	-320,823,251.78	353,663,917.46	32,840,665.68
本期基金份额交易产生的变动数	-35,258,616.04	-24,267,836.53	-59,526,452.57
其中：基金申购款	52,927,062.78	36,330,680.70	89,257,743.48
基金赎回款	-88,185,678.82	-60,598,517.23	-148,784,196.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	492,042,932.88	528,024,305.76	1,020,067,238.64

#### 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

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	69,478.94
其他	15,938.45
合计	982,623.38

注：表中“其他”指直销申购款利息收入和存出保证金利息收入。

#### 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	5,020,457,509.06
减：卖出股票成本总额	5,312,360,839.52
买卖股票差价收入	-291,903,330.46

#### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期末未有债券投资收益。

#### 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	9,818,977.26
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,818,977.26

#### 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	353,663,917.46
——股票投资	353,670,468.68
——债券投资	-6,551.22
——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	353,663,917.46

#### 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	341,754.05
合计	341,754.05

#### 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	14,893,126.72
银行间市场交易费用	-
合计	14,893,126.72

#### 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	44,630.98
信息披露费	148,765.71
帐户维护费	9,180.00
银行划款费用	15,435.56
合计	218,012.25

## 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，本基金无需作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

## 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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	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

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1月1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	996,673,427.67	10.13%	2,748,523,560.31	16.42%

#### 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

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1月1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	-	-	600,000,000.00	100.00%

### 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

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	911,770.61	10.13%	165,630.40	4.47%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	2,527,896.15	16.46%	1,469,056.40	14.41%

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

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	21,387,712.60	28,217,605.02

其中：支付销售机构的客户维护费	7,477,253.41	9,592,155.42
-----------------	--------------	--------------

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
当期发生的基金应支付的托管费	3,564,618.79	4,702,934.12

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内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：本基金本期和上年可比期间均未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
中国农业银行股份有限公司	165,766,405.64	897,205.99	410,982,371.47	2,381,443.28

**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：本基金本报告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	-



300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
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
002175	东方网络	2017年3月9日	重大资产重组停牌	14.23	2017年7月13日	14.74	9,964,216	138,500,269.72	141,790,793.68	-
300340	科恒股份	2017年6月5日	重大资产重组停牌	40.11	-	-	2,996,864	173,714,190.40	120,204,215.04	-
300518	盛讯达	2016年12月13日	重大资产重组停牌	113.30	2017年7月10日	101.97	1,306	29,019.32	147,969.80	-
603861	白云电器	2017年6月15日	重大资产重组	24.27	-	-	4,056	34,476.00	98,439.12	-

			组 停 牌							
300510	金冠 电气	2017 年 3 月 10 日	重 大 资 产 重 组 停 牌	34.85	2017 年 7 月 11 日	35.00	2,730	16,789.50	95,140.50	-
603238	诺邦 股份	2017 年 5 月 15 日	重 大 资 产 重 组 停 牌	29.38	2017 年 8 月 23 日	31.99	1,750	23,292.50	51,415.00	-
300291	华录 百纳	2017 年 4 月 19 日	重 大 资 产 重 组 停 牌	20.02	-	-	2,410	80,474.97	48,248.20	-
002856	美芝 股份	2017 年 6 月 19 日	重 大 资 产 重 组 停 牌	31.86	-	-	1,230	14,280.30	39,187.80	-
300582	英飞 特	2017 年 6 月 5 日	重 大 资 产 重 组 停 牌	18.92	2017 年 8 月 2 日	17.50	2,038	20,181.15	38,558.96	-
603501	韦	2017	重	20.15	-	-	1,657	11,632.14	33,388.55	-

	尔股份	年 6 月 5 日	大资产重组停牌							
000034	神州数码	2017 年 3 月 21 日	重大资产重组停牌	23.12	2017 年 7 月 18 日	22.01	831	20,698.09	19,212.72	-

### 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。本基金投资于一家上市公司发行的证券市

值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在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。本基金所持有的证券均在证券交易所上市；因此，除在附注 7.4.12 以及 7.4.14.3 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要求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	165,766,405.64	-	-	-	-	-	165,766,405.64

结算备付金	4,847,722.30	-	-	-	-	-	4,847,722.30
存出保证金	1,244,965.80	-	-	-	-	-	1,244,965.80
交易性金融资产	38,495.90	-	43,444.80	-	-	-2,668,202,218.17	2,668,284,158.87
应收证券清算款	-	-	-	-	-	11,485,782.99	11,485,782.99
应收利息	-	-	-	-	-	40,434.84	40,434.84
应收申购款	206,659.96	-	-	-	-	364,445.19	571,105.15
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	172,104,249.60	-	43,444.80	-	-	-2,680,092,881.19	2,852,240,575.59
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,326,298.00	4,326,298.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,383,159.45	3,383,159.45
应付托管费	-	-	-	-	-	563,859.91	563,859.91
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,705,661.37	3,705,661.37
其他负债	-	-	-	-	-	301,791.47	301,791.47
负债总计	-	-	-	-	-	12,280,770.20	12,280,770.20
利率敏感度缺口	172,104,249.60	-	43,444.80	-	-	-2,667,812,110.99	2,839,959,805.39
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	173,418,049.17	-	-	-	-	-	173,418,049.17
结算备付金	6,681,245.69	-	-	-	-	-	6,681,245.69
存出保证金	2,831,948.81	-	-	-	-	-	2,831,948.81
交易性金融资产	-	-	-	45,603.60	42,888.32	2,809,011,145.23	2,809,099,637.15
应收利息	-	-	-	-	-	44,012.78	44,012.78
应收申购款	98,398.77	-	-	-	-	890,628.31	989,027.08
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	183,029,642.44	-	0.00	45,603.60	42,888.32	2,809,945,786.32	2,993,063,920.68
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,980,772.29	3,980,772.29
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,306,300.43	3,306,300.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,978,197.88	3,978,197.88
应付托管费	-	-	-	-	-	663,032.96	663,032.96
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,687,018.23	4,687,018.23
其他负债	-	-	-	-	-	421,093.35	421,093.35

负债总计	-	-	-	-	-	17,036,415.14	17,036,415.14
利率敏感度缺口	183,029,642.44	-	0.00	45,603.60	42,888.32	2,792,909,371.18	2,976,027,505.54

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金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 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,668,202,218.17	93.95	2,809,011,145.23	94.39
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	81,940.70	0.00	88,491.92	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	2,668,284,158.87	93.95	2,809,099,637.15	94.39

注：本基金股票投资占基金资产的 60-95%，债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5-40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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	. 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；		
	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 指数上涨 5%	132,074,015.41	33,005,890.56
	沪深 300 指数下跌 5%	-132,074,015.41	-33,005,890.56

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	2,668,202,218.17	93.55
	其中：股票	2,668,202,218.17	93.55
2	固定收益投资	81,940.70	0.00
	其中：债券	81,940.70	0.00
	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	170,614,127.94	5.98
7	其他各项资产	13,342,288.78	0.47
8	合计	2,852,240,575.59	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	43,443.42	0.00
B	采矿业	52,967.70	0.00
C	制造业	2,053,192,775.18	72.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,628.70	0.00
E	建筑业	364,251.33	0.01
F	批发和零售业	33,739,338.27	1.19
G	交通运输、仓储和邮政业	40,689.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	386,309,741.52	13.60
J	金融业	61,239,328.23	2.16
K	房地产业	36,390.00	0.00
L	租赁和商务服务业	103,809.11	0.00



M	科学研究和技术服务业	100,657.93	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	131,303,601.01	4.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	214,742.94	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,340,916.05	0.05
S	综合	36,936.90	0.00
	合计	2,668,202,218.17	93.95

### 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002236	大华股份	10,003,071	228,170,049.51	8.03
2	603799	华友钴业	3,058,035	185,867,367.30	6.54
3	300450	先导智能	3,148,559	163,000,899.43	5.74
4	002475	立讯精密	4,869,978	142,398,156.72	5.01
5	002175	东方网络	9,964,216	141,790,793.68	4.99
6	002466	天齐锂业	2,528,110	137,402,778.50	4.84
7	002273	水晶光电	6,507,902	134,258,018.26	4.73
8	600884	杉杉股份	7,358,749	121,198,596.03	4.27
9	300340	科恒股份	2,996,864	120,204,215.04	4.23
10	603869	北部湾旅	4,380,818	119,202,057.78	4.20
11	300033	同花顺	1,790,261	111,372,136.81	3.92
12	002384	东山精密	4,499,330	111,133,451.00	3.91
13	002340	格林美	18,047,295	109,186,134.75	3.84
14	002455	百川股份	10,722,664	105,082,107.20	3.70
15	300416	苏试试验	3,822,018	95,435,789.46	3.36
16	002460	赣锋锂业	1,878,274	86,870,172.50	3.06
17	002415	海康威视	2,456,573	79,347,307.90	2.79
18	600702	沱牌舍得	2,499,930	66,523,137.30	2.34
19	601601	中国太保	1,750,853	59,301,391.11	2.09
20	600406	国电南瑞	3,000,000	52,950,000.00	1.86
21	002668	奥马电器	2,631,430	51,839,171.00	1.83

22	300059	东方财富	3,999,832	48,077,980.64	1.69
23	300184	力源信息	2,699,398	33,580,511.12	1.18
24	002095	生意宝	911,211	31,491,452.16	1.11
25	600584	长电科技	1,602,475	25,719,723.75	0.91
26	600418	江淮汽车	1,999,860	21,098,523.00	0.74
27	002008	大族激光	500,000	17,320,000.00	0.61
28	600328	兰太实业	1,099,910	12,802,952.40	0.45
29	002159	三特索道	499,971	11,999,304.00	0.42
30	300618	寒锐钴业	126,000	11,881,800.00	0.42
31	603626	科森科技	99,957	6,515,197.26	0.23
32	002635	安洁科技	175,675	6,362,948.50	0.22
33	002850	科达利	49,941	4,534,143.39	0.16
34	300136	信维通信	70,535	2,822,810.70	0.10
35	601169	北京银行	190,839	1,749,993.63	0.06
36	002343	慈文传媒	31,305	1,185,207.30	0.04
37	600661	新南洋	10,002	214,742.94	0.01
38	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.01
39	300078	思创医惠	15,748	168,976.04	0.01
40	300518	盛讯达	1,306	147,969.80	0.01
41	603861	白云电器	4,056	98,439.12	0.00
42	300510	金冠电气	2,730	95,140.50	0.00
43	603980	吉华集团	3,449	91,846.87	0.00
44	603689	皖天然气	4,818	82,628.70	0.00
45	603133	碳元科技	2,445	82,054.20	0.00
46	603186	华正新材	1,874	80,150.98	0.00
47	300505	川金诺	1,893	79,714.23	0.00
48	002789	建艺集团	1,500	76,950.00	0.00
49	300512	中亚股份	3,746	75,968.88	0.00
50	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.00
51	603298	杭叉集团	3,641	75,477.93	0.00
52	002815	崇达技术	2,244	74,141.76	0.00
53	603339	四方冷链	2,793	72,226.98	0.00
54	002224	三力士	6,434	71,417.40	0.00
55	601811	新华文轩	4,549	70,782.44	0.00
56	603421	鼎信通讯	2,480	69,415.20	0.00
57	002851	麦格米特	1,708	68,097.96	0.00
58	300508	维宏股份	970	67,318.00	0.00
59	603179	新泉股份	1,495	65,645.45	0.00
60	603639	海利尔	1,206	64,062.72	0.00

61	002832	比音勒芬	1,158	63,771.06	0.00
62	300529	健帆生物	2,150	63,554.00	0.00
63	603728	鸣志电器	2,719	63,434.27	0.00
64	002793	东音股份	2,826	63,358.92	0.00
65	300610	晨化股份	2,694	63,228.18	0.00
66	300600	瑞特股份	1,123	62,551.10	0.00
67	603569	长久物流	1,853	61,945.79	0.00
68	603779	威龙股份	2,809	61,460.92	0.00
69	300526	中潜股份	1,968	61,421.28	0.00
70	603638	艾迪精密	1,674	59,728.32	0.00
71	603826	坤彩科技	3,299	59,579.94	0.00
72	300601	康泰生物	2,109	59,178.54	0.00
73	603101	汇嘉时代	3,563	59,145.80	0.00
74	603218	日月股份	1,652	58,546.88	0.00
75	603131	上海沪工	2,526	57,794.88	0.00
76	603615	茶花股份	2,915	57,687.85	0.00
77	603637	镇海股份	1,802	56,474.68	0.00
78	300580	贝斯特	2,489	56,251.40	0.00
79	300599	雄塑科技	3,155	55,843.50	0.00
80	603667	五洲新春	2,404	55,628.56	0.00
81	002869	金溢科技	1,255	54,592.50	0.00
82	603896	寿仙谷	1,392	54,301.92	0.00
83	603585	苏利股份	1,562	53,810.90	0.00
84	300630	普利制药	1,488	53,716.80	0.00
85	300611	美力科技	2,402	53,684.70	0.00
86	603177	德创环保	2,779	52,967.74	0.00
87	603505	金石资源	2,570	52,967.70	0.00
88	603690	至纯科技	3,106	52,895.18	0.00
89	603266	天龙股份	1,562	52,873.70	0.00
90	603416	信捷电气	1,506	52,725.06	0.00
91	603203	快克股份	1,363	52,461.87	0.00
92	603578	三星新材	1,142	52,155.14	0.00
93	603803	瑞斯康达	2,245	52,016.65	0.00
94	603238	诺邦股份	1,750	51,415.00	0.00
95	603028	赛福天	3,309	50,098.26	0.00
96	300346	南大光电	2,200	50,094.00	0.00
97	300596	利安隆	2,319	49,997.64	0.00
98	603929	亚翔集成	2,193	49,386.36	0.00
99	603903	中持股份	1,031	49,271.49	0.00

100	603726	朗迪集团	1,361	49,254.59	0.00
101	603050	科林电气	1,256	48,933.76	0.00
102	300291	华录百纳	2,410	48,248.20	0.00
103	002774	快意电梯	3,441	48,174.00	0.00
104	300657	弘信电子	1,021	48,089.10	0.00
105	300588	熙菱信息	1,380	48,010.20	0.00
106	603178	圣龙股份	2,578	47,847.68	0.00
107	603665	康隆达	1,185	47,577.75	0.00
108	603029	天鹅股份	1,618	47,002.90	0.00
109	600491	龙元建设	4,374	46,933.02	0.00
110	603035	常熟汽饰	2,316	46,760.04	0.00
111	002840	华统股份	1,814	46,202.58	0.00
112	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
113	002826	易明医药	2,181	45,670.14	0.00
114	002803	吉宏股份	1,165	45,435.00	0.00
115	300597	吉大通信	2,646	45,405.36	0.00
116	002849	威星智能	1,060	45,262.00	0.00
117	002824	和胜股份	1,816	45,036.80	0.00
118	603758	秦安股份	2,441	45,036.45	0.00
119	300552	万集科技	1,349	44,247.20	0.00
120	603909	合诚股份	1,095	44,183.25	0.00
121	603886	元祖股份	2,241	43,968.42	0.00
122	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
123	002200	云投生态	2,517	43,443.42	0.00
124	300633	开立医疗	2,324	43,272.88	0.00
125	300658	延江股份	1,110	43,101.30	0.00
126	002798	帝王洁具	1,056	42,789.12	0.00
127	300591	万里马	3,115	42,675.50	0.00
128	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	0.00
129	603855	华荣股份	2,728	41,792.96	0.00
130	300517	海波重科	1,446	41,673.72	0.00
131	002819	东方中科	1,293	41,518.23	0.00
132	002875	安奈儿	1,158	41,514.30	0.00
133	002835	同为股份	2,252	41,436.80	0.00
134	603069	海汽集团	3,388	40,689.88	0.00
135	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.00
136	002813	路畅科技	1,296	40,383.36	0.00
137	300593	新雷能	1,519	40,086.41	0.00
138	002866	传艺科技	1,488	40,071.84	0.00

139	300556	丝路视觉	1,226	40,053.42	0.00
140	603767	中马传动	1,785	39,751.95	0.00
141	002520	日发精机	4,096	39,239.68	0.00
142	002856	美芝股份	1,230	39,187.80	0.00
143	300622	博士眼镜	1,280	38,950.40	0.00
144	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
145	300587	天铁股份	1,438	38,567.16	0.00
146	300582	英飞特	2,038	38,558.96	0.00
147	002842	翔鹭钨业	932	38,118.80	0.00
148	300606	金太阳	1,228	38,080.28	0.00
149	002860	星帅尔	777	37,995.30	0.00
150	300621	维业股份	1,758	37,867.32	0.00
151	601882	海天精工	2,148	37,332.24	0.00
152	600624	复旦复华	5,330	36,936.90	0.00
153	002865	钧达股份	1,246	36,881.60	0.00
154	603926	铁流股份	1,082	36,712.26	0.00
155	300592	华凯创意	1,583	36,678.11	0.00
156	002838	道恩股份	1,021	36,551.80	0.00
157	600621	华鑫股份	3,000	36,390.00	0.00
158	002863	今飞凯达	2,249	36,343.84	0.00
159	002802	洪汇新材	1,128	36,321.60	0.00
160	002877	智能自控	1,436	36,302.08	0.00
161	603787	新日股份	1,849	36,184.93	0.00
162	603811	诚意药业	953	35,918.57	0.00
163	002868	绿康生化	1,234	35,872.38	0.00
164	300609	汇纳科技	1,037	35,537.99	0.00
165	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
166	300626	华瑞股份	1,208	35,140.72	0.00
167	002870	香山股份	1,046	35,093.30	0.00
168	603042	华脉科技	1,232	35,013.44	0.00
169	603389	亚振家居	1,963	34,607.69	0.00
170	603633	徕木股份	1,258	34,179.86	0.00
171	300620	光库科技	986	34,095.88	0.00
172	300603	立昂技术	1,034	33,894.52	0.00
173	603538	美诺华	1,122	33,480.48	0.00
174	603388	元成股份	891	33,474.87	0.00
175	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.00
176	300643	万通智控	2,026	33,165.62	0.00
177	002189	利达光电	1,984	33,132.80	0.00

178	002808	苏州恒久	1,805	33,031.50	0.00
179	603196	日播时尚	2,082	32,666.58	0.00
180	002799	环球印务	1,620	32,238.00	0.00
181	603488	展鹏科技	1,837	32,074.02	0.00
182	603041	美思德	1,034	31,340.54	0.00
183	300652	雷迪克	966	30,863.70	0.00
184	300663	科蓝软件	1,292	30,788.36	0.00
185	300647	超频三	1,244	30,602.40	0.00
186	300637	扬帆新材	1,312	30,595.84	0.00
187	002817	黄山胶囊	839	30,506.04	0.00
188	603226	菲林格尔	872	29,892.16	0.00
189	300632	光莆股份	1,237	29,811.70	0.00
190	002816	和科达	1,000	29,500.00	0.00
191	300589	江龙船艇	1,189	29,201.84	0.00
192	300605	恒锋信息	916	29,128.80	0.00
193	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.00
194	300586	美联新材	1,006	28,117.70	0.00
195	300514	友讯达	1,024	27,535.36	0.00
196	300659	中孚信息	776	27,175.52	0.00
197	603229	奥翔药业	1,340	26,558.80	0.00
198	300655	晶瑞股份	873	25,814.61	0.00
199	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
200	603536	惠发股份	1,008	24,141.60	0.00
201	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
202	603269	海鸥股份	795	23,357.10	0.00
203	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
204	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
205	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
206	000034	神州数码	831	19,212.72	0.00
207	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
208	603528	多伦科技	1,104	15,864.48	0.00
209	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
210	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
211	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
212	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
213	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
214	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
215	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
216	002137	麦达数字	143	1,297.01	0.00

217	002316	键桥通讯	45	623.25	0.00
218	600867	通化东宝	12	218.88	0.00
219	300223	北京君正	6	146.10	0.00
220	002618	丹邦科技	9	107.73	0.00
221	300312	邦讯技术	6	75.96	0.00
222	002649	博彦科技	6	66.18	0.00
223	000919	金陵药业	3	32.46	0.00
224	300352	北信源	5	28.85	0.00
225	600422	昆药集团	2	22.68	0.00
226	300071	华谊嘉信	2	16.20	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	002466	天齐锂业	213,865,108.95	7.19
2	002236	大华股份	213,824,943.16	7.18
3	300340	科恒股份	173,714,190.40	5.84
4	603799	华友钴业	156,817,201.47	5.27
5	002415	海康威视	150,077,198.59	5.04
6	002273	水晶光电	142,015,573.36	4.77
7	300450	先导智能	136,428,115.48	4.58
8	002460	赣锋锂业	131,795,059.47	4.43
9	000582	北部湾港	122,621,198.08	4.12
10	600884	杉杉股份	120,068,576.49	4.03
11	603993	洛阳钼业	119,779,698.00	4.02
12	002384	东山精密	116,306,352.87	3.91
13	300033	同花顺	115,766,107.63	3.89
14	002340	格林美	113,575,270.16	3.82
15	002008	大族激光	84,735,836.51	2.85
16	002668	奥马电器	84,164,370.66	2.83
17	601601	中国太保	81,686,722.90	2.74
18	002281	光迅科技	80,362,814.22	2.70
19	002475	立讯精密	77,840,535.56	2.62

20	300059	东方财富	72,525,233.24	2.44
21	000728	国元证券	69,644,242.74	2.34
22	600702	沱牌舍得	66,443,645.20	2.23
23	600988	赤峰黄金	63,452,536.78	2.13
24	000920	南方汇通	62,817,591.77	2.11
25	002142	宁波银行	62,247,753.72	2.09

注：本项“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	002236	大华股份	210,302,740.42	7.07
2	000615	京汉股份	129,782,588.29	4.36
3	000582	北部湾港	127,528,288.73	4.29
4	603993	洛阳钼业	112,063,777.78	3.77
5	002466	天齐锂业	108,280,166.56	3.64
6	002226	江南化工	103,063,636.41	3.46
7	002415	海康威视	99,906,246.93	3.36
8	000920	南方汇通	98,705,468.22	3.32
9	000851	高鸿股份	92,809,890.52	3.12
10	300456	耐威科技	85,870,573.48	2.89
11	002281	光迅科技	80,252,965.68	2.70
12	600459	贵研铂业	78,807,257.18	2.65
13	002316	键桥通讯	78,056,706.09	2.62
14	002008	大族激光	78,055,709.83	2.62
15	300422	博世科	76,560,826.67	2.57
16	300409	道氏技术	73,306,119.81	2.46
17	600639	浦东金桥	71,131,222.94	2.39
18	000060	中金岭南	68,884,729.53	2.31
19	002428	云南锗业	68,279,832.39	2.29
20	000728	国元证券	68,154,992.00	2.29
21	600141	兴发集团	66,952,569.82	2.25
22	300176	鸿特精密	65,613,060.93	2.20
23	002460	赣锋锂业	65,404,675.19	2.20
24	300033	同花顺	64,627,273.58	2.17
25	300098	高新兴	63,222,506.38	2.12
26	002142	宁波银行	63,019,109.95	2.12



27	600686	金龙汽车	60,178,129.10	2.02
28	300308	中际装备	59,886,284.24	2.01
29	600988	赤峰黄金	59,691,550.90	2.01

注：本项“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	4,817,881,443.78
卖出股票收入（成交）总额	5,020,457,509.06

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	81,940.70	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	81,940.70	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	420	43,444.80	0.00
2	128013	洪涛转债	380	38,495.90	0.00

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

### 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	1,244,965.80
2	应收证券清算款	11,485,782.99
3	应收股利	-
4	应收利息	40,434.84
5	应收申购款	571,105.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,342,288.78

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	43,444.80	0.00
2	128013	洪涛转债	38,495.90	0.00

**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	002175	东方网络	141,790,793.68	4.99	重大资产重组停牌
2	300340	科恒股份	120,204,215.04	4.23	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
230,512	7,895.00	14,546,263.50	0.80%	1,805,346,303.25	99.20%

### 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	346,092.67	0.02%

### 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	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年3月29日）基金份额总额	5,622,650,211.18
本报告期期初基金份额总额	1,929,274,480.01
本报告期基金总申购份额	166,222,551.32
减：本报告期基金总赎回份额	275,604,464.58
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	1,819,892,566.75

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。

## § 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. 本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 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	
长江证券	2	3,614,273,619.87	36.75%	3,312,007.51	36.80%	-
兴业证券	2	2,239,813,627.17	22.77%	2,050,170.99	22.78%	-
民生证券	2	1,163,070,881.58	11.83%	1,062,281.87	11.80%	-
东方证券	2	996,673,427.67	10.13%	911,770.61	10.13%	-
方正证券	2	719,509,124.09	7.32%	670,075.33	7.45%	-
恒泰证券	2	300,675,537.35	3.06%	275,583.45	3.06%	-
华创证券	1	286,975,557.93	2.92%	261,522.04	2.91%	-
招商证券	2	244,415,541.80	2.49%	225,542.43	2.51%	-
海通证券	2	89,050,289.14	0.91%	81,152.02	0.90%	-
西藏东方财富	2	87,616,675.83	0.89%	64,073.65	0.71%	-

国泰君安	2	76,512,081.24	0.78%	71,255.81	0.79%	-
中金公司	2	16,202,296.82	0.16%	14,781.91	0.16%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	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
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-



国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

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：

本基金报告期内新增 1 家证券公司的 2 个交易单元：西藏东方财富（上交所单元和深交所单元），  
 退租 1 家证券公司的 1 个交易单元：财富证券（上交所单元）。

**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（星网锐捷）	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 1 月 14 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告（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
6	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
7	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金通过盈米财富申购金额下限的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 2 月 21 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加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
9	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
10	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
11	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

12	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
13	汇添富基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告(副总经理)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 10 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国都证券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 3 月 13 日
15	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
16	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
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
19	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
20	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
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
22	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
23	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中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
24	汇添富基金管理股份有限公司关	中证报, 证券时报,	2017 年 4 月 18 日

	于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告（东方网络）	上证报, 公司网站	
25	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
26	汇添富旗下公募基金 2017 年一季度报	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
27	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
28	汇添富社会责任混合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 4 月 28 日
29	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
30	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
31	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
32	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 11 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

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社会责任混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富社会责任混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富社会责任混合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、报告期内汇添富社会责任股票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](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2017 年 8 月 26 日