

汇添富新兴消费股票型证券投资基金 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.....	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.....	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.....	15
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
§5 托管人报告	16
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
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
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.11 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55

§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富新兴消费股票型证券投资基金
基金简称	汇添富新兴消费股票
基金主代码	001726
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 2 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	1,655,820,077.88 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于新兴消费主题的优质上市公司。本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，精选消费行业的优质上市公司，结合市场脉络，做中长期布局，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。
业绩比较基准	中证主要消费行业指数*40%+中证可选消费行业指数*40%+中债综合指数*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金

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	北京市西城区复兴门内大街 55

	号 6 栋 538 室	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	http://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 楼 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	-50,286,032.51
本期利润	174,700,584.27
加权平均基金份额本期利润	0.0893
本期加权平均净值利润率	9.36%
本期基金份额净值增长率	10.04%
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	-130,195,902.64
期末可供分配基金份额利润	-0.0786
期末基金资产净值	1,722,994,640.92
期末基金份额净值	1.041
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	4.10%

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

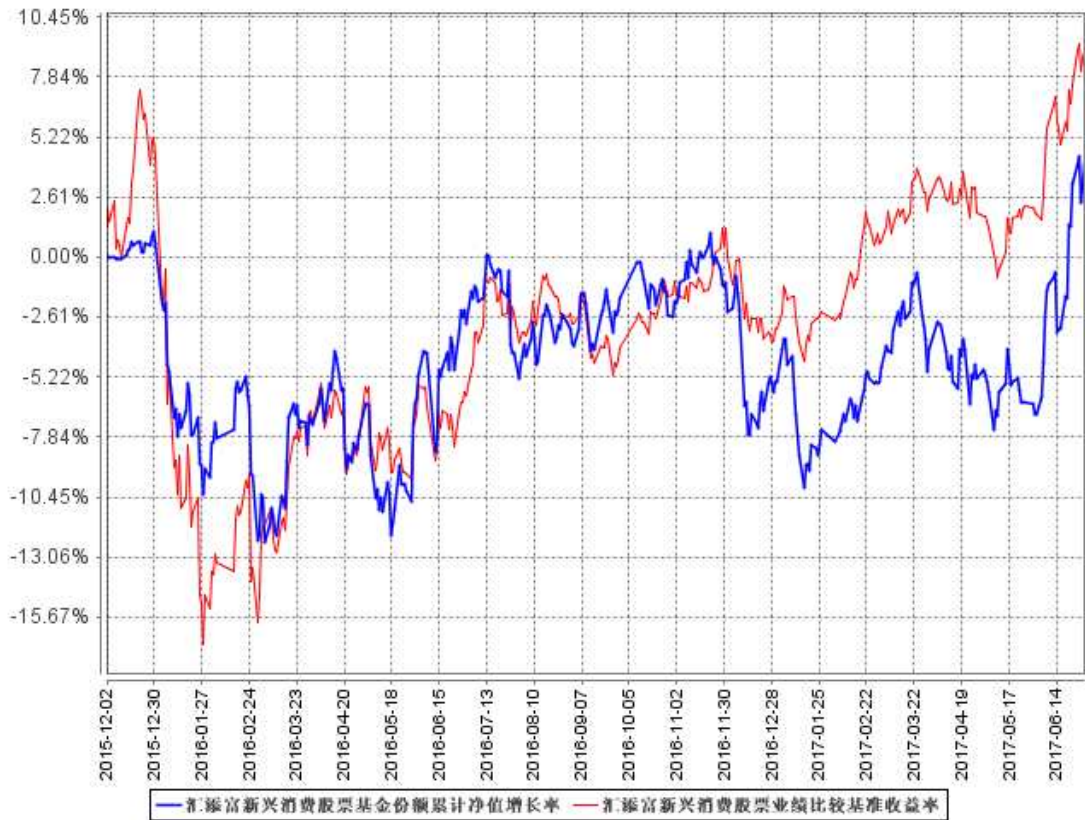
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	11.22%	1.25%	6.53%	0.77%	4.69%	0.48%
过去三个月	8.44%	1.05%	5.95%	0.68%	2.49%	0.37%
过去六个月	10.04%	0.92%	11.96%	0.62%	-1.92%	0.30%
过去一年	6.55%	0.89%	15.39%	0.66%	-8.84%	0.23%
自基金合同生效日起至	4.10%	1.01%	8.76%	1.08%	-4.66%	-0.07%

今						
---	--	--	--	--	--	--

注：本基金的《基金合同》生效日为 2015 年 12 月 02 日，至本报告期末未满 3 年。

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

汇添富新兴消费股票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(2015年12月02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		
雷鸣	汇添富成长焦点混合基金、汇添富蓝筹稳健混合、汇添富新兴消费股票的基金经理。	2015年12月2日	2017年6月20日	10年	国籍：中国。学历：华中科技大学管理学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2007年6月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任行业分析师、高级行业分析师，2014年3月27日至今任汇添富成长焦点混合基金的基金经理，2015年1月6日至今任汇添富蓝筹稳健混合股票

					基金的基金经理，2015 年 12 月 2 日至 2017 年 6 月 20 日任汇添富新兴消费股票基金的基金经理。
刘伟林	汇添富新兴消费股票基金的基金经理。	2015 年 12 月 2 日	-	9 年	国籍：中国。学历：北京大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2008 年 7 月加入汇添富基金任行业分析师；2010 年 5 月至 2011 年 3 月在国家发展和改革委员会工作；2011 年 3 月至今在我司担任高级策略分析师。2015 年 12 月 2 日至今任汇添富新兴消费股票基金的基金经理。

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 年上半年市场的脉络比较清晰，结构性行情非常突出。其中，以银行、保险、家电和白酒为代表的大金融+大消费行业，表现非常好，这类行业的典型特征：估值优势明显、商业模式清晰、盈利稳定增长，尤其龙头企业表现最好。而依靠外延并购的资产、高市盈率、小市值、壳价值的资产持续调整，这和 13-15 年的市场风格形成鲜明对比。整体来看，市场从给新、小、奇资产以估值溢价，转向给龙头、大市值、稳定增长资产以估值溢价。

这种结构性行情与风格的变化与上半年的宏观背景和市场环境有紧密的联系：

第一、市场流动性环境从非常宽松转向中性。全球来看，美联储的加息动作尽管非常温和，但加息的方向非常确定、缩表也在稳健进行，全球流动性环境正在经历拐点。国内来看，流动性从宽松转中性的趋势非常明显，阶段性甚至出现紧张局面。这就意味着，过去多年依赖流动性提升估值、扩张市值的资产遇到了一个中长期的拐点，尤其估值偏高的话，持续回归和调整的压力较大。而对于估值优势明显，增长非常稳健的资产来看，依然可以通过盈利的增长带动市值的扩张。这也是高市盈率的中小市值股票和低估值蓝筹表现分化的最主要原因之一。

第二、市场的风险溢价下降，投资者对资产稳健性的考虑放到更加重要的位置。今年上半年证券市场环境整体偏紧，尤其对高送转、并购重组、股东减持等做出了细致规定，这些措施长期正本清源有利市场长期表现，而短期内市场的风险偏好下降。商业模式是否清晰、行业地位是否突出、业绩增长是否确定成为投资者的首要考虑。而沪港通、深港通开通后，国际投资者对国内

资产定价能力增强。国际投资者相对青睐于大市值的龙头公司。这些新增资金对于市场的定价模式在边际上有重要的影响。

第三、企业的盈利出现分化，龙头企业的优势地位逐步突出。以白电等行业为例，整个行业的增长相对温和，但产业格局良好，龙头企业规模优势、品牌优势显现，盈利能力持续提升。龙头企业体现出高于行业的盈利增速。而很多中小市值企业，尤其过度依赖于对外融资和外延扩张的企业，一旦受政策收紧的影响，增速出现较大幅度回落。整体来看，在不少行业，强者恒强的格局在形成，大企业的规模优势、渠道优势、品牌优势正在形成牢固的护城河，拉大与小企业的差距。

从我们基金运作来看，我们相对前瞻的看到了市场这种深刻的变化，因此在配置资产时严格贯彻行业适度均衡、个股相对集中，自下而上精选个股的原则，在景气度向好、产业结构非常好的行业里挑选出最优质的龙头个股集中持有。在投资主线上，我们贯彻了两条主线，第一条是商业模式清晰、盈利增长确定性强、估值优势明显的资产。主要集中在白酒、家电、家居、中药等大消费类资产以及银行、保险等大金融类资产；第二条主线是行业增速非常快，成长空间巨大的成长类资产。主要集中在新能源汽车、消费电子等资产里。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年上半年，本基金净值上涨 10.04%，业绩基准上涨 11.96%。同期沪深 300 上涨 10.78%，中小板上涨 7.33%，创业板下跌 7.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对下半年的宏观环境和证券市场的几点判断：

第一、经济总需求相对稳定。宏观经济从年初的相对谨慎到年中相对乐观，投资者的预期出现了较大的波动。但我们判断，宏观总需求相对平稳。尽管一二线城市的房地产市场受调控影响整体回落，但三四线城市受购买力溢出效应以及城镇化加快影响，成为维持总需求的有利动力。

第二、供给侧改革对资源、材料等行业出现深刻影响。对于煤炭、有色、化工等行业，长期受制于产能过剩，导致盈利能力较差。但供给侧改革加速供需结构的平衡，尤其在部分品种，过去多年的低迷导致新增产能非常有限，在改革推动下改变供需格局，许多传统资产盈利有望有力提升

第三、市场流动性环境整体中性偏紧。大的宏观货币环境应该维持中性，金融去杠杆、防范局部风险是大的方向。证券市场来看，新股票的发行维持较快的速度，市场流动性整体中性偏紧。

第四、投资者结构发生深刻变化，加速市场定价模式的变化。一方面，A 股国际化的步伐加

快，估值水平与国际逐步结构；另一方面，国内机构投资者占比上升，市场定价模式发生变化。

整体来看，我们判断 17 年上半年市场风格的变化是一个中长期的深刻变化，下半年会进一步深化。在市场指数不会有大的变化的基础上，结构性行情从消费、金融等大类资产扩散到包括资源行业、制造行业的龙头企业。

从投资策略来看，我们维持上半年大的策略原则：行业相对均衡、个股相对集中。在商业模式清晰、盈利增长确定的行业里寻找龙头股的投资机会。同时，在增长最有爆发性的行业里寻找成长类资产。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

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新兴消费股票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，汇添富新兴消费股票型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富新兴消费股票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，汇添富新兴消费股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富新兴消费股票型证券投资基金 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：汇添富新兴消费股票型证券投资基金

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	156,257,911.41	243,901,028.81
结算备付金		4,121,463.41	4,126,706.83
存出保证金		601,898.04	660,888.68
交易性金融资产	6.4.7.2	1,577,745,728.31	1,734,814,935.55
其中：股票投资		1,577,745,728.31	1,734,814,935.55
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		-	57,711.79
应收利息	6.4.7.5	29,332.82	147,616.69
应收股利		-	-
应收申购款		28,079,523.05	981,560.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,766,835,857.04	1,984,690,448.36
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		25,569,002.89	2,621,648.13
应付赎回款		12,736,579.16	10,154,305.79
应付管理人报酬		2,212,163.15	2,543,062.01
应付托管费		368,693.83	423,843.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,706,240.38	2,422,345.84

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	248,536.71	290,001.86
负债合计		43,841,216.12	18,455,207.30
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,655,820,077.88	2,078,932,317.56
未分配利润	6.4.7.10	67,174,563.04	-112,697,076.50
所有者权益合计		1,722,994,640.92	1,966,235,241.06
负债和所有者权益总计		1,766,835,857.04	1,984,690,448.36

注：1. 报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.041 元，基金份额总额 1,655,820,007.88 份。

2. 报表附注为财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：汇添富新兴消费股票型证券投资基金

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		200,184,635.02	-71,135,295.99
1.利息收入		834,593.46	7,378,917.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	834,593.46	6,098,305.92
债券利息收入		-	746.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,279,865.40
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-25,713,301.49	-158,544,882.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-37,717,151.83	-165,236,161.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	1,793,696.53
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	12,003,850.34	4,897,582.77
3.公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.7.17	224,986,616.78	79,378,638.53

号填列)			
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	76,726.27	652,029.95
减: 二、费用		25,484,050.75	27,988,370.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,889,198.08	19,227,902.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,314,866.35	3,204,650.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	9,082,250.02	5,404,914.98
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	197,736.30	150,902.70
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		174,700,584.27	-99,123,666.90

注: 报表附注为财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 汇添富新兴消费股票型证券投资基金

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)	2,078,932,317.56	-112,697,076.50	1,966,235,241.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	174,700,584.27	174,700,584.27
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)	-423,112,239.68	5,171,055.27	-417,941,184.41
其中: 1.基金申购款	72,361,027.30	528,079.56	72,889,106.86
2.基金赎回款	-495,473,266.98	4,642,975.71	-490,830,291.27
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	1,655,820,077.88	67,174,563.04	1,722,994,640.92

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)	2,891,766,352.32	17,880,631.70	2,909,646,984.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-99,123,666.90	-99,123,666.90
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)	-273,468,600.91	21,895,839.49	-251,572,761.42
其中：1.基金申购款	52,396,194.53	-4,024,829.36	48,371,365.17
2.基金赎回款	-325,864,795.44	25,920,668.85	-299,944,126.59
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)	2,618,297,751.41	-59,347,195.71	2,558,950,555.70

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

汇添富新兴消费股票型证券投资基金(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【2015】1545号文《关于核准汇添富新兴消费股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由汇添富基金管理股份有限公司作为发起人于2015年11月3日至2015年11月23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(2015)验字第60466941_B37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2015年12月2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 2,891,040,757.91 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 725,594.41 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 2,891,766,352.32 元，折合 2,891,766,352.32 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等）、债券回购、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款（含定期存款、协议存款、大额存单等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金采用自下而上的策略，以基本面分析为立足点，主要投资于新兴消费的优质上市公司，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。本基金的业绩比较基准为中证主要消费产业指数收益率*40%+中证可选消费行业指数*40%+中债综合指数*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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

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	156,257,911.41
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 1 个月以内	-
存款期限 3 个月~1 年	-
其他存款	-
合计：	156,257,911.41

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	1,330,709,191.44	1,577,745,728.31	247,036,536.87
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	1,330,709,191.44	1,577,745,728.31	247,036,536.87

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/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	27,419.96
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	1,669.14
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	243.72
合计	29,332.82

注：“其他”指应收交易保证金利息。

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	2,706,240.38
银行间市场应付交易费用	-

合计	2,706,240.38
----	--------------

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	16.41
预提信息披露费	203,889.32
预提审计费	-
审计费用	44,630.98
预提费用	-
应付信息披露费	-
应付审计费	-
合计	248,536.71

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	2,078,932,317.56	2,078,932,317.56
本期申购	72,361,027.30	72,361,027.30
本期赎回(以“-”号填列)	-495,473,266.98	-495,473,266.98
- 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	1,655,820,077.88	1,655,820,077.88

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	-119,363,485.60	6,666,409.10	-112,697,076.50
本期利润	-50,286,032.51	224,986,616.78	174,700,584.27
本期基金份额交易产生的变动数	39,453,615.47	-34,282,560.20	5,171,055.27

其中：基金申购款	-6,203,851.40	6,731,930.96	528,079.56
基金赎回款	45,657,466.87	-41,014,491.16	4,642,975.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-130,195,902.64	197,370,465.68	67,174,563.04

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	742,681.43
定期存款利息收入	50,000.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	36,759.17
其他	5,152.86
合计	834,593.46

注：“其他”指结算保证金和申购款利息收入。

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	3,128,599,380.88
减：卖出股票成本总额	3,166,316,532.71
买卖股票差价收入	-37,717,151.83

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内未投资债券。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内未投资资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内未投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内未投资衍生工具。

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	12,003,850.34
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,003,850.34

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	224,986,616.78
——股票投资	224,986,616.78
——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	224,986,616.78

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	76,726.27
合计	76,726.27

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	9,082,250.02
银行间市场交易费用	-
合计	9,082,250.02

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	133,889.32
账户维护费	-
银行划款费	-
银行划款费用	616.00
帐户维护费	18,600.00
合计	197,736.30

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、基金注册登记机构、基金销售机构
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：下述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	545,557,085.67	9.23%	414,278,108.01	10.22%

6.4.10.1.2 债券交易

注：本报告期内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	-	-	1,200,000,000.00	12.24%

6.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期内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	501,672.15	9.24%	393,984.73	14.56%
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	377,986.37	10.18%	148,384.09	6.12%

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	13,889,198.08	19,227,902.79
其中：支付销售机构的客户维护费	5,120,868.39	9,524,958.15

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

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的托管费	2,314,866.35	3,204,650.44

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金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首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

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：本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

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内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及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	156,257,911.41	742,681.43	455,382,854.02	4,188,423.51

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：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

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

注：本基金本报告期末未有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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同责任，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股票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

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，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、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	156,257,911.41	-	-	-	-	-	156,257,911.41
结算备付金	4,121,463.41	-	-	-	-	-	4,121,463.41
存出保证金	601,898.04	-	-	-	-	-	601,898.04
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,577,745,728.31	1,577,745,728.31
应收利息	-	-	-	-	-	29,332.82	29,332.82
应收申购款	25,101,899.93	-	-	-	-	2,977,623.12	28,079,523.05
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	186,083,172.79	-	-	-	-	1,580,752,684.25	1,766,835,857.04
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	25,569,002.89	25,569,002.89
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,736,579.16	12,736,579.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,212,163.15	2,212,163.15
应付托管费	-	-	-	-	-	368,693.83	368,693.83
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,706,240.38	2,706,240.38
其他负债	-	-	-	-	-	248,536.71	248,536.71
负债总计	-	-	-	-	-	43,841,216.12	43,841,216.12
利率敏感度缺口	186,083,172.79	-	-	-	-	-1,536,911,468.13	1,722,994,640.92
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	243,901,028.81	-	-	-	-	-	243,901,028.81
结算备付金	4,126,706.83	-	-	-	-	-	4,126,706.83
存出保证金	660,888.68	-	-	-	-	-	660,888.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,734,814,935.55	1,734,814,935.55
应收证券清算款	-	-	-	-	-	57,711.79	57,711.79

应收利息	-	-	-	-	147,616.69	147,616.69
应收申购款	938,142.76	-	-	-	43,417.25	981,560.01
资产总计	249,626,767.08	-	-	-	-1,735,063,681.28	1,984,690,448.36
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	2,621,648.13	2,621,648.13
应付赎回款	-	-	-	-	10,154,305.79	10,154,305.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,543,062.01	2,543,062.01
应付托管费	-	-	-	-	423,843.67	423,843.67
应付交易费用	-	-	-	-	2,422,345.84	2,422,345.84
其他负债	-	-	-	-	290,001.86	290,001.86
负债总计	-	-	-	-	18,455,207.30	18,455,207.30
利率敏感度缺口	249,626,767.08	-	-	-	-1,716,608,473.98	1,966,235,241.06

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：本基金本报告期末及上期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响；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的股票，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	1,577,745,728.31	91.57	1,734,814,935.55	88.23
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,577,745,728.31	91.57	1,734,814,935.55	88.23

注：股票资产不低于基金资产的 80%，投资于民营企业上市公司股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，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%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表。

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%	56,889,869.25	33,678,992.56
	沪深300指数下跌5%	-56,889,869.25	-33,678,992.56

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	1,577,745,728.31	89.30
	其中：股票	1,577,745,728.31	89.30
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	160,379,374.82	9.08
7	其他各项资产	28,710,753.91	1.62
8	合计	1,766,835,857.04	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,201,000,286.34	69.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	123,435,229.86	7.16
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	7,639.62	0.00
J	金融业	253,302,572.49	14.70
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

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	1,577,745,728.31	91.57

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	000651	格力电器	3,910,319	160,987,833.23	9.34
2	002236	大华股份	6,792,831	154,944,475.11	8.99
3	000333	美的集团	3,571,569	153,720,329.76	8.92
4	601601	中国太保	3,895,492	131,940,314.04	7.66
5	002035	华帝股份	5,245,208	126,934,033.60	7.37
6	603108	润达医疗	7,748,602	123,435,229.86	7.16
7	000858	五粮液	2,204,404	122,697,126.64	7.12
8	600036	招商银行	5,075,795	121,362,258.45	7.04
9	300450	先导智能	1,834,611	94,977,811.47	5.51
10	002508	老板电器	2,091,966	90,958,681.68	5.28
11	000921	海信科龙	5,019,668	86,388,486.28	5.01
12	000568	泸州老窖	1,365,559	69,069,974.22	4.01
13	603898	好莱客	1,743,899	60,949,270.05	3.54
14	000423	东阿阿胶	482,560	34,691,238.40	2.01
15	002572	索菲亚	646,289	26,497,849.00	1.54
16	600436	片仔癀	293,052	17,887,894.08	1.04
17	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
18	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
19	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
20	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00

21	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
22	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
23	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
24	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
25	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
26	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
27	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
28	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
29	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
30	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
31	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	000333	美的集团	171,502,792.88	8.72
2	002236	大华股份	132,295,361.94	6.73
3	601601	中国太保	122,215,598.35	6.22
4	000921	海信科龙	113,909,478.89	5.79
5	600036	招商银行	113,431,417.51	5.77
6	601688	华泰证券	107,252,172.86	5.45
7	000858	五粮液	103,148,203.58	5.25
8	000423	东阿阿胶	102,024,686.97	5.19
9	002508	老板电器	86,812,158.88	4.42
10	300450	先导智能	85,055,076.08	4.33
11	300113	顺网科技	84,972,878.74	4.32
12	002611	东方精工	77,354,661.37	3.93
13	002116	中国海诚	70,758,565.73	3.60
14	603008	喜临门	70,347,842.12	3.58
15	000568	泸州老窖	68,291,835.53	3.47
16	603369	今世缘	67,217,461.18	3.42
17	600104	上汽集团	66,447,533.33	3.38

18	000651	格力电器	65,990,226.40	3.36
19	002572	索菲亚	56,658,555.57	2.88
20	600436	片仔癀	56,531,814.77	2.88
21	603368	柳州医药	56,167,926.29	2.86
22	002035	华帝股份	53,202,186.88	2.71
23	603833	欧派家居	50,960,487.92	2.59
24	600686	金龙汽车	48,818,273.17	2.48
25	000728	国元证券	47,837,394.80	2.43
26	603898	好莱客	44,513,782.69	2.26
27	600872	中炬高新	43,519,805.21	2.21
28	002027	分众传媒	42,723,366.12	2.17

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，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	600172	黄河旋风	174,966,924.69	8.90
2	002094	青岛金王	168,491,302.94	8.57
3	000661	长春高新	152,852,923.01	7.77
4	601688	华泰证券	104,977,039.24	5.34
5	600686	金龙汽车	100,040,853.19	5.09
6	600079	人福医药	98,840,828.77	5.03
7	002142	宁波银行	96,204,895.66	4.89
8	000423	东阿阿胶	83,750,584.30	4.26
9	002350	北京科锐	81,749,358.82	4.16
10	603898	好莱客	80,564,226.59	4.10
11	300113	顺网科技	80,081,847.66	4.07
12	000915	山大华特	74,858,820.82	3.81
13	603369	今世缘	68,944,829.62	3.51
14	600104	上汽集团	67,702,826.63	3.44
15	000651	格力电器	65,240,289.21	3.32
16	002611	东方精工	62,491,403.65	3.18
17	603008	喜临门	60,475,096.42	3.08
18	601799	星宇股份	59,967,059.15	3.05
19	002116	中国海诚	56,662,215.56	2.88

20	600867	通化东宝	52,585,794.12	2.67
21	603368	柳州医药	52,336,089.83	2.66
22	000921	海信科龙	51,941,713.95	2.64
23	603833	欧派家居	51,860,386.30	2.64
24	002343	慈文传媒	51,016,482.24	2.59
25	000728	国元证券	48,265,570.84	2.45
26	300031	宝通科技	46,543,017.44	2.37
27	002027	分众传媒	43,647,489.27	2.22
28	600872	中炬高新	43,531,374.35	2.21
29	600436	片仔癀	42,962,202.47	2.18
30	000333	美的集团	42,340,232.08	2.15

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，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	2,784,260,708.69
卖出股票收入（成交）总额	3,128,599,380.88

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成本金额填列，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。

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投资。

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投资。

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：本基金本报告期末未持有股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

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、处罚的情形。

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	601,898.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,332.82
5	应收申购款	28,079,523.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,710,753.91

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

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§ 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
23,714	69,824.58	24,554,336.04	1.48%	1,631,265,741.84	98.52%

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	23,052.55	0.0014%

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（2015年12月2日）基金份额总额	2,891,766,352.32
本报告期期初基金份额总额	2,078,932,317.56
本报告期基金总申购份额	72,361,027.30
减：本报告期基金总赎回份额	495,473,266.98
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	1,655,820,077.88

注：表内“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

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。
本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西南证券	2	665,664,993.14	11.26%	607,202.23	11.18%	-
东北证券	2	586,967,432.67	9.93%	538,417.05	9.92%	-
东方证券	2	545,557,085.67	9.23%	501,672.15	9.24%	-
中信证券	2	431,796,183.35	7.31%	394,133.89	7.26%	-
平安证券	1	396,327,651.21	6.71%	361,174.29	6.65%	-
光大证券	1	386,798,376.05	6.55%	360,223.87	6.63%	-
高华证券	1	378,863,764.89	6.41%	345,259.05	6.36%	-
德邦证券	1	368,982,164.69	6.24%	343,632.27	6.33%	-
银河证券	2	310,851,395.18	5.26%	283,278.70	5.22%	-
兴业证券	2	305,292,805.89	5.17%	284,316.57	5.24%	-
浙商证券	1	270,157,793.56	4.57%	246,194.60	4.53%	-
安信证券	2	248,124,101.71	4.20%	227,153.29	4.18%	-

上海证券	1	214,562,328.89	3.63%	199,819.90	3.68%	-
长江证券	1	187,756,479.46	3.18%	174,861.65	3.22%	-
申万宏源	2	135,156,678.05	2.29%	124,637.46	2.30%	-
广州证券	2	122,331,562.58	2.07%	111,480.73	2.05%	-
中金公司	2	111,674,702.92	1.89%	101,769.14	1.87%	-
渤海证券	1	58,041,184.33	0.98%	54,053.10	1.00%	-
华泰证券	1	51,376,352.65	0.87%	47,847.23	0.88%	-
方正证券	3	45,778,169.45	0.77%	41,717.86	0.77%	-
招商证券	2	42,435,356.34	0.72%	38,856.23	0.72%	-
中信建投	1	18,560,993.02	0.31%	17,285.84	0.32%	-
瑞银证券	1	9,792,302.82	0.17%	9,119.55	0.17%	-
广发证券	1	6,773,976.72	0.11%	6,308.58	0.12%	-
国泰君安	2	6,241,995.38	0.11%	5,812.97	0.11%	-
信达证券	1	3,443,966.60	0.06%	3,207.20	0.06%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	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
西南证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

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：

本基金本报告期末新增或退租交易单元。

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	汇添富新兴消费股票型证券投资基金更新招募说明书(2016 年第 2 号)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 1 月 16 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

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
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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
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	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 23 日

	部开展的申购基金费率优惠活动的公告		
20	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
21	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
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
23	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
24	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
25	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加海通证券开展的申购、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
27	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
28	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
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	中证报, 证券时报,	2017 年 6 月 9 日

	于旗下部分基金参加江苏银行开展的费率优惠活动的公告	上证报, 公司网站	
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
34	汇添富基金管理股份有限公司关于调整基金经理的公告 (新兴消费)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 6 月 21 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新兴消费股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富新兴消费股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富新兴消费股票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、报告期内汇添富新兴消费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 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