

# 汇添富恒生指数分级证券投资基金 2017 年 年度报告

2017 年 12 月 31 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：2018 年 03 月 28 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2018年3月26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。

本报告期自2017年1月1日起至12月31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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 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.....	18
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>51</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	51
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	51
8.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	51
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	52
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	61
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	63
8.7 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 .....	63
8.8 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 .....	63
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细 .....	64
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	64
8.11 投资组合报告附注 .....	64
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	67
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>67</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>68</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	68
11.2 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 .....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	71
11.4 基金投资策略的改变 .....	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
11.8 其他重大事件 .....	72
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>77</b>
12.1 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 .....	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	77
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>77</b>
13.1 备查文件目录 .....	77
13.2 存放地点 .....	78
13.3 查阅方式 .....	78

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富恒生指数分级证券投资基金		
基金简称	汇添富恒生指数分级(QDII)		
场内简称	添富恒生		
基金主代码	164705		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年03月06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	461,795,058.39 份		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2014年04月11日		
下属分级基金的基金简称	恒生 A	恒生 B	添富恒生
下属分级基金的交易代码	150169	150170	164705
报告期末下属分级基金的份 额总额	149,470,400.00 份	149,470,400.00 份	162,854,258.39 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数及标的指数所表征的股票市场相似的风险收益特征，在股票基金中属于中等风险、中等收益的产品。本基金为境外证券投资的基金，主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。此外，从投资者具体持有的基金份额来看，在分级运作期内，由于基金收益分配的安排，稳健收益类的

	恒生 A 份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额；积极收益类的恒生 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。
--	---

### 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	贺倩
	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 号震旦国际大厦 21-23 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		李文	周慕冰

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	香港上海汇丰银行有限公司
	英文	The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.
注册地址		香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		香港九龙深旺道一号, 汇丰中心一座六楼

注：本基金无境外投资顾问。

### 2.5 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21-23 楼 汇添富基金管理股份有限公司

### 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	119,407,209.42	-1,140,718.47	-585,734,239.67
本期利润	224,400,400.01	138,595,014.42	-750,300,709.18
加权平均基金份额本期利润	0.2939	0.0891	-0.3026
本期加权平均净值利润率	26.58%	9.54%	-28.66%
本期基金份额净值增长率	27.39%	7.64%	-7.15%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	-62,549,034.87	59,960,430.66	-54,340,172.08
期末可供分配基金份额利润	-0.1354	0.0412	-0.0347
期末基金资产净值	577,807,055.59	1,460,855,379.05	1,508,911,118.96
期末基金份额净值	1.251	1.005	0.963
3.1.3 累计期末指标	2017年末	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	35.19%	6.15%	-1.39%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	6.29%	0.83%	6.48%	0.85%	-0.19%	-0.02%
过去六个月	11.90%	0.75%	11.25%	0.77%	0.65%	-0.02%
过去一年	27.30%	0.70%	25.63%	0.71%	1.67%	-0.01%
过去三年	27.23%	1.06%	32.70%	1.07%	-5.47%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今	35.12%	1.00%	38.42%	1.02%	-3.30%	-0.02%

注：本基金的《基金合同》生效日为2014年3月6日，至本报告期末未满五年。

#### 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

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（2014年3月6日）起6个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1、本基金的《基金合同》生效日为2014年3月6日,至本报告期末满五年。

2、合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金2015年、2016年、2017年均未进行利润分配。

## § 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

汇添富基金成立于2005年2月,是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设在上海,在北京、上海、广州、成都等地设有分公司,在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全,拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人及QFII基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来,始终将投资业绩放在首位,形成了独树一帜的品牌优势,被誉为“选股专家”,并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务,赢得了广大基金持有人和海内外机构的

认可和信赖。

目前，汇添富基金已经发展成为长期业绩优异、产品布局完善、业务领域全面、资产管理规模居前的大型基金公司。截至2017年12月31日，汇添富资产管理总规模超过5500亿元，其中公募资产管理规模（剔除货基口径）1892亿元，位居行业第7；服务客户超过6000万人。根据银河证券基金研究中心数据，汇添富旗下股票基金最近3年、5年的股票投资主动管理平均收益率分别达到89.86%、184.98%，在公募规模（不含货基）前十大基金公司中均排名第一。优秀的业绩赢得了行业与市场的高度认可。2017年，汇添富基金荣获“金基金·TOP公司奖”、“三年持续回报明星基金公司”、“优秀资产管理机构”等奖项，汇添富价值精选、汇添富民营活力荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，汇添富上海国企ETF荣获“上海金融创新成果奖”，“添富智投”荣登“2017中国智能投顾新锐榜”。

2017年，汇添富基金新发行22只公募基金，包括11只混合型基金，5只指数基金，3只债券基金以及3只QDII基金。其中，上证上海改革发展主题ETF为助力国企改革创新产品，汇添富全球移动互联网混合基金和汇添富全球医疗保健混合基金布局海外市场，进一步丰富完善了公司的国际产品线。全年，公司管理公募基金产品达到97只，涵盖股票型、混合型、债券型、理财、QFII、指数、商品、货币基金等风险程度和预期收益从高到低的各类产品，为投资者提供更加全面的资产配置选择。

2017年，汇添富基金大力发展自有平台建设，不断引领行业创新。全年推出多款树立行业标杆的拳头功能：添富智投、添富养老、汇闪付、工资宝、理财日历、在线客服机器人等。规模稳定在千亿级别，服务客户数量超5000万，处于行业领先水平。与此同时，互联网金融对外合作业务取得重大突破。截至年底，对外合作伙伴数量已超80家，成为业内对外合作最多的公司之一。

2017年，汇添富基金稳步推行大机构战略，截至年底，公司机构理财总部保有规模达2900亿元；获得全国社保基金及基本养老保险基金投资管理人资格，社保基金和基本养老保险基金业务规模快速增长，受托管理组合账户数量持续增加。

2017年，公司积极开展渠道销售和培训工作，专业的投顾服务以及良好的渠道维护口碑不断提升汇添富品牌在渠道影响力和认可度。同时公司持续大力开展定投、投资者教育、添富论坛等系列客户活动，营销培训活动拓展到银行和券商的网点、营业部。

2017年，汇添富基金继续提升客户服务能力，全方位优化客户服务体系。公司通过完善大客户平台建设，搭建了囊括投顾式服务、基金理财、高端客户、现金宝的全新客服体系，为公司各项销售业务提供全方位支持。同时，持续优化电话、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提高客服体验。

2017年，香港子公司在加强母公司投研一体化基础上，深入发掘港股价值洼地，港股投资及海外债券投资业绩持续优异，汇添富中港策略基金获得晨星三年五星评级，在最近一年、三年、五年同类港股基金中业绩均位列第一；汇添富港币债券基金获得晨星三年四星评级，在同类型基金中持续名列第一。社保海外组合业绩在所有社保管理人中排名第一。

2017年，公司公益事业蓬勃发展，公益活动精彩纷呈，公益品牌建设更上一个台阶。一是依托公司旗下上海汇添富公益基金会的专业平台，连续第十年开展“河流·孩子”公益助学计划，并成立“河流·孩子”公益助学联盟，将项目的平台化建设推向新的高度。二是将公益事业与公司党建结合，催生出新活力和亮点。公司党委下属的八个党支部分别与各地“添富小学”建立结对关系，党员们通过实地探访，了解学校实际困难和发展需求，积极寻求社会公益资源给予帮助。三是持续开展“河流·孩子”相关品牌活动，延续爱心传递温暖。持续开展“河流·孩子”公益助学计划，组织100名添富小学乡村一线教师分赴上海苏州参加专业教师培训；继续组织西部助学公益活动，邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的“添富小学”参加公益服务；继续举办海外留学志愿者支教，帮助山区孩子打开的视野。其余员工公益活动持续精彩纷呈，向公司员工发售筹款台历、参加沪上知名的群众性公益活动——一个鸡蛋的暴走筹款4万多元，作为“添富小学”多媒体教室建设费用等。

2018年，资产管理行业面临重大行业变革期：混业竞争格局下严格依法从严监管；资管业务回归本源，短期业务失去快速扩张的土壤；互联网与金融的融合与碰撞将重构现有行业发展格局；港股通、沪伦通的发展，带动了A股国际化也进一步带来新的机遇与挑战。汇添富基金将始终坚信长期的力量，开拓进取、奋勇前行，为筑造中国梦添砖加瓦，为成为中国最优秀的资产管理公司的梦想努力奋斗！

#### 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		
赖中立	汇添富黄金及贵金属基金（LOF）的基金经理、汇添富恒生指数分级（QDII）	2014年3月6日		10年	国籍：中国，学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士，相关业务资格：证

	<p>基金、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富中证环境治理指数(LOF)基金、汇添富优选回报混合基金、汇添富中证港股通高股息投资指数(LOF)基金的基金经理。</p>			<p>券投资基 基金从业 资格。从业 经历：曾任 泰达宏利 基金管理 有限公司 风险管理 分析 师。2010 年8月加 入汇添富 基金管理 股份有限 公司，历 任金融工 程部分 析师、基 金经 理助 理。2012 年11月1 日至今任 汇添富黄 金及贵金 属基金 (LOF)的 基金 经 理，2014 年3月6 日至今任 汇添富恒 生指数分 级(QDII) 基金的 基金 经 理，2015 年1月6 日至今任 汇添富 深证 300ETF 基金、汇 添富 深证 300ETF 基金 联接 基金 的基金</p>
--	---	--	--	---

					经理， 2015年5月26日至 2016年7月13日任 汇添富香港优势混 合基金的基 金经理，2016 年12月29日至今 任汇添富 中证环境 治理指数 (LOF)基 金的基 金经理， 2017年5 月18日至今 任汇添 富优选回 报混合基 金的基 金经理， 2017年11 月24日至今 任汇添 富中证港 股通高股 息投资指 数(LOF) 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。

### 4.1.3 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

## 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 公平交易制度和控制方法

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》，本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究环节，公司建立了统一的投研平台信息管理系统，公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时，通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。（2）在投资环节，公司针对基金、专户、社保、境外投资分别设立了投资决策委员会，各委员会根据各自议事规则分别召开会议，在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略，独立制定资产配置计划和组合调整方案，并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。（3）在交易环节，公司实行集中交易，所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式，按照“时间优先、价格优先、比例分配”的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理，严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配，确保交易的公平性。（4）在交易监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析方面，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。同时，投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

### 4.3.2 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。报告期内，本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度，进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、清算，以及稽核监察等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3日、5日）同向交易的样本，根据95%置信区间下差价率的T检验显著程度、差价率均值是否小于1%、同向交易占优比等方面进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

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。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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11次，均是因为投资策略原因，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

回顾17年，香港市场展开了新一轮强势上涨行情，在全球权益类资产范围内排名靠前。我们认为，本轮香港市场的上涨，是以机构投资者为主导的，围绕增量资金布局和价值发现的双轮驱动行情。2016年深港通启动后，内地投资者配置港股已相当便利，机构大资金配置港股的力度逐渐增强，港股的投资生态逐渐转变，定价权开始也随着资金增量配置而开始转移。从价值发现的角度来看，恒生指数在经过本轮上涨之后，其估值依然处于历史相对低位，且大量优质港股标的依然具有较高的分红率，对长期配置资金具有极高吸引力。从经济基本面角度来看，在十九大之后国内经济相对平稳，人民币汇率保持稳健向好是港股走势向好的坚实基础，海外市场也处于经济复苏带来的乐观情绪推动当中，对香港市场影响较为正面。

报告期内，本基金按照基金合同，按照完全复制法进行恒生指数成份股指数化投资，严控基金跟踪误差，以为投资者带来与恒生指数一致的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金净值上涨 27.30%，业绩比较基准上涨 25.63%，超额收益为 1.67%。

#### 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 2018 年的港股市场，我们认为围绕香港上市的中国各大行业龙头将继续引领市场长期向好。从估值水平来看，香港市场在经历了本轮上涨之后，估值有所抬升，恒生指数的估值水平已经恢复到过去 30 年的均值水平，但一些行业的龙头上市公司随着盈利水平的不断提升，估值水平依然保持在非常具有吸引力的水平。经济基本面来看，十九大召开明确了未来长期的发展和改革目标，改革路径的明确和逐步落地将给中国经济带来新的活力，中国经济转型的步伐在改革开放 40 周年之际将继续提速，新经济蓬勃发展将为市场带来超预期的盈利提升，而传统行业如大金融板块也将在 2018 年迎来盈利提升。国外，美欧步入经济复苏的扩张周期，利好中国出口，给中国经济带来良好的外部环境，海外市场的走强也会为香港市场提振情绪。从资金面来看，香港市场依然是全球权益类资产的估值洼地，资金流入香港市场的趋势短期内不会出现反转，并且随着香港市场与国内市场互联互通机制的不断完善，国内大型机构对港股的配置将成为标配，配置比例也会得到不断提升。综上所述，我们对 2018 年香港市场持较为乐观的态度，恒生指数作为香港市场的标杆指数，具备非常突出的配置价值。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司以维护基金份额持有人利益为宗旨，有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则，认真履行职责，通过常规稽核、专项检查 and 系统监控等方式方法积极开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，促进内部控制和风险管理的不断改进，并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

##### （一）完善规章制度，健全内部控制体系

在本报告期内，督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估，并根据各项业务特点、业务发展实际，建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程，进一步明确了内部控制和风险管理责任，公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善，为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

##### （二）加强稽核监察，确保基金运作和公司经营合法合规



本报告期内，督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察，包括对基金投资交易行为、投资指标的监控，对投资组合的风险度量、评估和建议，对基金信息披露的审核、监督，对基金投资、销售、营销的稽核、控制，对基金营运、技术系统的稽核、评估，切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

### （三）强化培训教育，提高全员合规意识

本报告期内，督察长和稽核监察部门积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险意识、合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强内部控制和风险管理，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

## 4.7 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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及2017年9月5日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017年9月5日《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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决

有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

#### 4.8 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，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，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。

#### 4.9 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12月31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，汇添富恒生指数分级证券投资基金未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2018）审字第 60466941_B45 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富恒生指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的汇添富恒生指数分级证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的汇添富恒生指数分级证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富恒生指数分级证券投资基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富恒生指数分级证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富恒生指数分级证券投资基金管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实

任	<p>现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富恒生指数分级证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富恒生指数分级证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇添富恒生指数分级证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富恒生指数分级证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	陈 露   陈 军
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2018年3月27日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	44,190,573.08	213,415,655.46
结算备付金		8,067,077.77	131,724,540.75
存出保证金		101,059.80	16,512,654.60
交易性金融资产	7.4.7.2	526,906,761.50	1,111,861,005.54
其中：股票投资		526,906,761.50	1,111,861,005.54
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	9,485.20	18,031.92
应收股利		79,434.34	106,691.61
应收申购款		1,902,582.49	465,801.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		581,256,974.18	1,474,104,381.55
<b>负债和所有者权益</b>			
<b>附注号</b>		<b>本期末</b> 2017年12月31日	<b>上年度末</b> 2016年12月31日
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		365,462.60	112.43
应付赎回款		1,861,010.25	10,112,640.75
应付管理人报酬		575,090.75	1,584,947.80
应付托管费		119,810.54	330,197.43
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	7.4.7.7	44,435.31	255,488.15
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	484,109.14	965,615.94
负债合计		3,449,918.59	13,249,002.50
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	375,935,938.46	1,400,894,948.39
未分配利润	7.4.7.10	201,871,117.13	59,960,430.66
所有者权益合计		577,807,055.59	1,460,855,379.05
负债和所有者权益总计		581,256,974.18	1,474,104,381.55

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.251 元，基金份额总额 461,795,058.39 份，其中下属添富恒生份额净值 1.251 元，份额总额 162,854,258.39 份；下属恒生 A 份额净值 1.045 元，份额总额 149,470,400.00 份；下属恒生 B 份额净值 1.457 元，份额总额 149,470,400.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 01 月 01 日 至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		239,451,137.53	164,442,096.56
1. 利息收入		597,966.83	1,066,015.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	597,966.83	1,066,015.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	0.00
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		140,293,361.85	1,176,173.83
其中：股票投资收益	7.4.7.12	64,422,623.45	-58,841,264.07
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-

资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	56,258,662.55	25,005,944.35
股利收益	7.4.7.17	19,612,075.85	35,011,493.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	104,993,190.59	139,735,732.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-8,163,306.34	20,308,310.47
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	1,729,924.60	2,155,864.24
<b>减：二、费用</b>		15,050,737.52	25,847,082.14
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	10,209,911.19	17,389,960.83
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,127,064.74	3,622,908.38
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	1,916,644.17	3,791,660.06
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	797,117.42	1,042,552.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		224,400,400.01	138,595,014.42

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31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）	1,400,894,948.39	59,960,430.66	1,460,855,379.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利	-	224,400,400.01	224,400,400.01

润)			
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)	-1,024,959,009.93	-82,489,713.54	-1,107,448,723.47
其中: 1. 基金申购款	2,991,920,516.38	42,022,000.08	3,033,942,516.46
2. 基金赎回款	-4,016,879,526.31	-124,511,713.62	-4,141,391,239.93
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)	375,935,938.46	201,871,117.13	577,807,055.59
项目	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、上年初所有者权益(基金净值)	1,563,251,291.04	-54,340,172.08	1,508,911,118.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	138,595,014.42	138,595,014.42
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)	-162,356,342.65	-24,294,411.68	-186,650,754.33
其中: 1. 基金申购款	12,590,498,816.71	-126,968,622.72	12,463,530,193.99
2. 基金赎回款	-12,752,855,159.36	102,674,211.04	-12,650,180,948.32
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)	1,400,894,948.39	59,960,430.66	1,460,855,379.05

报表附注为财务报表的组成部分。



本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇添富恒生指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]1247号文《关于核准汇添富恒生指数分级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股份有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2014年3月6日正式生效，首次设立募集规模为1,270,631,138.98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为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司，境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司(The Hong Kong and Shanghai Banking Co., Ltd.)。

本基金的份额包括汇添富恒生指数分级证券投资基金之基础份额（简称“添富恒生份额”）、汇添富恒生指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“恒生A份额”）与汇添富恒生指数分级证券投资基金之积极收益类份额（简称“恒生B份额”）。其中，恒生A、恒生B的基金份额配比始终保持1:1的比率不变。本基金的基础份额为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。恒生A份额将具有低风险、收益稳定特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额，类似于债券型基金份额。恒生B份额则具有高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额，类似于具有收益杠杆性的股票型基金份额。

本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于债券、基金（包括股票基金、债券基金、交易所交易基金等）、金融衍生工具（包括远期合约、互换、期货、期权、权证等）、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的80%。本基金紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准：经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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（以下统称“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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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。

#### 7.4.3 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12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资等；

## (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同

资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(5) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(6) 基金投资收益/（损失）于卖出/赎回基金成交日确认，并按卖出/赎回基金成交金额与其成本的差额入账；

(7) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(8) 权证收益/（损失）于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股票股利收益于除息日确认，并按宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票所在地适用的预缴所得税后的净额入账；基金投资在持有期间取得的红利于除息日确认；

(10) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)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，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，场外投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。场内基金份额收益分配方式只能为

现金分红；场内基金份额具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及登记机构的相关规定；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

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]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 7.4.6.1 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
活期存款	44,190,573.08	213,415,655.46
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	44,190,573.08	213,415,655.46

注：本基金于2017年12月31日，银行存款中包含的外币余额为：港元10,561,636.37元（折合人民币8,828,577.46元），美元51.22元（折合人民币334.68元）。



7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		445,536,410.11	526,906,761.50	81,370,351.39
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		445,536,410.11	526,906,761.50	81,370,351.39
项目		上年度末 2016年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,140,190,711.63	1,111,861,005.54	-28,329,706.09
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		1,140,190,711.63	1,111,861,005.54	-28,329,706.09

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末			

	2016年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	255,387,972.06	4,706,866.89	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	255,387,972.06	4,706,866.89	-	-

注：(1) 本基金本期末未持有衍生金融资产；

(2) 上年度衍生金融资产项下的股指期货投资净额折合人民币 0.00 元。在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益折合人民币 4,706,866.89 元）；

(3) 上年度末持有恒生指数期货合约（Hang Seng Index Futures）260 张；

(4) 上年度末 2016 年 12 月 31 日权益衍生工具具体如下：

项目	持仓量（买/卖）	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
股指期货多头合约	260	255,387,972.06	260,094,838.95	4,706,866.89
总额合计：		4,706,866.89		
减：可抵销期货暂收款		-4,706,866.89		
股指期货投资净额：		0.00		

买入持仓量以正数列示，卖出持仓量以负数列示。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	8,136.94	14,741.75
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	1,348.26	3,290.17
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	-	-
合计	9,485.20	18,031.92

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	44,435.31	255,488.15
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	44,435.31	255,488.15

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付赎回费	6,693.73	35,950.63
应付审计费	50,000.00	50,000.00
应付信息披露费	300,000.00	300,000.00
应付指数使用费	127,415.41	579,665.31
合计	484,109.14	965,615.94

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年末	1,454,060,153.39	1,400,894,948.39
本期申购	2,991,920,516.38	2,991,920,516.38
本期赎回(以“-”号填列)	-4,016,879,526.31	-4,016,879,526.31
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	32,693,914.93	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	461,795,058.39	375,935,938.46

#### 7.4.7.10 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
----	-------	-------	---------

上年末	-146,078,262.40	206,038,693.06	59,960,430.66
本期利润	119,407,209.42	104,993,190.59	224,400,400.01
本期基金份额交易产生的变动数	-35,877,981.89	-46,611,731.65	-82,489,713.54
其中：基金申购款	21,326,687.72	20,695,312.36	42,022,000.08
基金赎回款	-57,204,669.61	-67,307,044.01	-124,511,713.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-62,549,034.87	264,420,152.00	201,871,117.13

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12 月31日
活期存款利息收入	562,037.92	979,942.57
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	28,315.71	75,986.29
其他	7,613.20	10,086.27
合计	597,966.83	1,066,015.13

注：其他为直销申购款和交易保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年 12月31日
卖出股票成交总额	922,686,101.63	912,024,855.69
减：卖出股票成本总额	858,263,478.18	970,866,119.76
买卖股票差价收入	64,422,623.45	-58,841,264.07

#### 7.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2017年01月01日至2017年12月31日	2016年01月01日至2016年12月31日
股指期货投资收益	56,258,662.55	25,005,944.35

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年01月01日至2017年12月31日	2016年01月01日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	19,612,075.85	35,011,493.55
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	19,612,075.85	35,011,493.55

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2017年01月01日至2017年12月31日	2016年01月01日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	109,700,057.48	135,047,213.38
——股票投资	109,700,057.48	135,047,213.38
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-4,706,866.89	4,688,519.51
合计	104,993,190.59	139,735,732.89

注：“其他”为股指期货公允价值变动损益。

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年01月01日至2017年12月31日	2016年01月01日至2016年12月31日
基金赎回费收入	1,729,924.60	2,155,864.24
合计	1,729,924.60	2,155,864.24

## 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016 年12月31日
交易所市场交易费用	1,916,644.17	3,791,660.06
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,916,644.17	3,791,660.06

## 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016 年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
证券组合费	28,016.14	35,763.71
汇款费	18,391.33	16,883.85
指数使用费	340,330.42	579,665.31
上市费	60,000.00	60,000.00
其他	379.53	240.00
合计	797,117.42	1,042,552.87

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的披露

## 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除7.4.6税项中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
上海汇丰银行有限公司（“汇丰银行”）	基金境外托管人
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
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
上海上投资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批的关键管理人员

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31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	485,117,129.52	44.78	1,289,493,154.24	77.28

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 基金交易

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基金交易。

###### 7.4.10.1.5 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。

###### 7.4.10.1.6 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01月01日至2017年12月31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	485,113.43	72.99%	44,435.31	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31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	1,289,491.68	71.57%	255,488.15	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年01月01日至 2017年12月31日	2016年01月01日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,209,911.19	17,389,960.83
其中：支付销售机构的客户维护费	681,552.46	559,366.40

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年01月01日至 2017年12月31日	2016年01月01日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,127,064.74	3,622,908.38

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。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日



等, 支付日期顺延。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注: 本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.2 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

份额单位: 份

恒生 A				
关联方名称	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)
东方证券股份有限公司	0.00	0.00%	1,957,700.00	0.33%
恒生 B				
关联方名称	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)
东方证券股份有限公司	0.00	0.00%	200,000.00	0.03%

注: 东方证券股份有限公司于2016年12月7日买入恒生A1,960,000份,于2016年12月13日买入恒生A1,970,000份,于2016年12月26日卖出恒生A1,972,300份;东方证券股份有限公司分别于2016年9月7日、2016年9月13日、2016年9月30日、2016年11月22日买入恒生B50,000份;东方证券股份有限公司于2017年1月3日卖出恒生A1,957,700.00份,于2017年3月14日买入恒生A97,600.00份,于2017年4月18日买入恒生A100,000.00份,于2017年4月25日卖出恒生A6,500.00份,于2017年4月26日卖出恒生A191,100.00份;东方证券股份有限公司于2017年5月12日卖出恒生B100,000.00份,于2017年5月22日卖出恒生B100,000.00份。

### 7.4.10.5 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01月01日至2017年12月 31日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31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	35,361,708.25	557,736.16	90,195,287.01	974,914.93
上海汇丰银行有限公司（“汇丰银行”）	8,828,864.83	3,302.69	123,220,368.45	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国农业银行和境外资产托管人汇丰银行保管，按适用利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 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持有暂时停牌等流通受限股票

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构10%以上具有投票权的证券发行总量。此外，基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。

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，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。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，本报告期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	44,190,573.08	-	-	-	-	-	44,190,573.08
备付金	8,067,077.77	-	-	-	-	-	8,067,077.77
存出保证金	101,059.80	-	-	-	-	-	101,059.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	526,906.761.50	526,906.761.50
应收股利	-	-	-	-	-	79,434.34	79,434.34
应收利息	-	-	-	-	-	9,485.20	9,485.20
应收申购款	20,445.46	-	-	-	-	1,882,137.03	1,902,582.49
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-

应收买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	52,379,156.11	-	-	-	-	528,877,818.07	581,256,974.18
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,861,010.25	1,861,010.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	575,090.75	575,090.75
应付托管费	-	-	-	-	-	119,810.54	119,810.54
应付证券清算款	-	-	-	-	-	365,462.60	365,462.60
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	44,435.31	44,435.31
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	484,109.14	484,109.14
负债总计	-	-	-	-	-	3,449,918.59	3,449,918.59
利率敏感度缺口	52,379,156.11	-	-	-	-	525,427,899.48	577,807,055.59
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	213,415,655.46	-	-	-	-	-	213,415,655.46
备付金	131,724,540.75	-	-	-	-	-	131,724,540.75
存出保证金	16,512,654.60	-	-	-	-	-	16,512,654.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,111,861,005.54	1,111,861,005.54
应收股利	-	-	-	-	-	106,691.61	106,691.61

应收利息	-	-	-	-	-	18,031.92	18,031.92
应收申购款	20,824.99	-	-	-	-	444,976.68	465,801.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	361,673,675.80	-	-	-	-	1,112,430,705.75	1,474,104,381.55
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,112,640.75	10,112,640.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,584,947.80	1,584,947.80
应付托管费	-	-	-	-	-	330,197.43	330,197.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	255,488.15	255,488.15
应付证券清算款	-	-	-	-	-	112.43	112.43
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	965,615.94	965,615.94
负债总计	-	-	-	-	-	13,249,002.50	13,249,002.50
利率敏感度缺口	361,673,675.80	-	-	-	-	1,099,181,703.25	1,460,855,379.05

注：上表统计了本基金资产及负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度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，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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	334.68	8,828,577.46	-	8,828,912.14
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	526,906,761.50	-	526,906,761.50
应收股利	-	79,434.34	-	79,434.34
应收利息	-	5.80	-	5.80
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
结算备付金	-	8,067,077.77	-	8,067,077.77
资产合计	334.68	543,881,856.87	-	543,882,191.55
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	365,377.57	-	365,377.57
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-

应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	365,377.57	-	365,377.57
资产负债表外汇风险敞口净额	334.68	543,516,479.30	-	543,516,813.98
项目	上年度末 2016年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	355.31	123,220,156.37	-	123,220,511.68
存出保证金	-	16,512,654.60	-	16,512,654.60
交易性金融资产	-	1,111,861,005.54	-	1,111,861,005.54
应收股利	-	106,691.61	-	106,691.61
应收利息	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
结算备付金	-	131,724,540.75	-	131,724,540.75
资产合计	355.31	1,383,425,048.87	-	1,383,425,404.18
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	355.31	1,383,425,048.87	-	1,383,425,404.18

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑管理人人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。
----	---



	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12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
分析	港币相对人民币升值 5%	27,171,852.25	69,165,917.86
	港币相对人民币贬值 5%	-27,171,852.25	-69,165,917.86
	美元相对人民币升值 5%	16.73	17.77
	美元相对人民币贬值 5%	-16.73	-17.77

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金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。本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。另外还可投资于债券、基金、金融衍生工具、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31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	526,906,761.50	91.19	1,111,861,005.54	76.11
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	526,906,761.50	91.19	1,111,861,005.54	76.11

注：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的 80%。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。

**7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	1、本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合的贝塔系数紧密相关； 2、以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	经人民币汇率调整的恒生指数收益率增加5%	26,219,402.84	67,894,233.64
	经人民币汇率调整的恒生指数收益率减少5%	-26,219,402.84	-67,894,233.64

**7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2017年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币526,906,761.50元，无划分为第二层次和第三层次的余额（于2016年12月31日，属于第一层次的余额为人民币1,111,861,005.54元，无划分为第二层次和第三层次的余额）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2018年3月21日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	526,906,761.50	90.65
	其中：普通股	526,906,761.50	90.65
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	52,257,650.85	8.99
8	其他各项资产	2,092,561.83	0.36
9	合计	581,256,974.18	100.00

注：1、本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 419,122,283.96 人民币，占期末净值比例 72.54%。

2、由于四舍五入的原因市值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
香港	526,906,761.50	91.19
合计	526,906,761.50	91.19

### 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
10 能源	29,542,835.72	5.11
15 原材料	-	-
20 工业	24,436,599.06	4.23

25	非必需消费品	21,827,967.37	3.78
30	必需消费品	13,998,474.86	2.42
35	医疗保健	-	-
40	金融	256,636,235.75	44.42
45	信息技术	61,741,014.77	10.69
50	电信服务	31,347,088.94	5.43
55	公用事业	24,737,488.41	4.28
60	房地产	62,639,056.62	10.84
	合计	526,906,761.50	91.19

注：1. 以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

2. 由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	HSBC Holdings Plc	汇丰控股有限公司	5 HK	香港联合交易所	香港	811,200.00	54,213,310.85	9.38
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	香港	148,900.00	50,533,601.60	8.75
3	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港联	香港	804,600.00	44,827,002.85	7.76

				合交易所				
4	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港联合交易所	香港	7,209,000.00	43,387,741.37	7.51
5	China Mobile Limited	中国移动有限公司	941 HK	香港联合交易所	香港	409,500.00	27,127,682.75	4.69
6	Industrial and Commercial Bank of China Limited	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港联合交易所	香港	4,916,000.00	25,847,708.09	4.47
7	Ping An Insurance(Group)Company of China Ltd	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港联合交易所	香港	347,500.00	23,630,444.27	4.09
8	Bank of China Limited	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港联合交易所	香港	5,293,000.00	16,989,971.06	2.94

9	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd	香港交易及结算有限公司	388 HK	香港 联合 交易 所	香港	78,500. 00	15,735,4 20.62	2. 72
10	CK Hutchison Holdings Limited	长江和记实业有限公司	1 HK	香港 联合 交易 所	香港	179,848 .00	14,748,0 34.36	2. 55
11	CNOOC Limited	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港 联合 交易 所	香港	1,190,0 00.00	11,160,9 03.14	1. 93
12	China Life Insurance Company Limited	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香港 联合 交易 所	香港	496,000 .00	10,178,7 08.89	1. 76
13	CK Asset Holdings Limited	长江实业集团有限公司	1113 HK	香港 联合 交易 所	香港	172,348 .00	9,839,80 4.56	1. 70
14	Sun Hung Kai Properties Ltd	新鸿基地产发展有限公司	16 HK	香港 联合 交	香港	87,000. 00	9,483,23 1.77	1. 64

				易所				
15	Link Real Estate Investment Trust	领展房地产投资信托基金	823 HK	香港联合交易所	香港	148,000 .00	8,963,12 8.57	1. 55
16	CLP Holdings Ltd	中电控股有限公司	2 HK	香港联合交易所	香港	126,500 .00	8,454,12 2.07	1. 46
17	Galaxy Entertainment Group Limited	银河娱乐集团有限公司	27 HK	香港联合交易所	香港	158,000 .00	8,281,02 6.01	1. 43
18	Hang Seng Bank Ltd	恒生银行有限公司	11 HK	香港联合交易所	香港	51,000. 00	8,270,49 3.54	1. 43
19	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港(控股)有限公司	2388 HK	香港联合交易所	香港	246,500 .00	8,159,65 1.88	1. 41
20	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港	香港	1,700,0 00.00	8,142,59 9.31	1. 41

				联合交易所				
21	Geely Automobile Holdings Limited	吉利汽车控股有限公司	175 HK	香港联合交易所	香港	358,000 .00	8,109,83 1.64	1. 40
22	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd	香港中华煤气有限公司	3 HK	香港联合交易所	香港	558,822 .00	7,156,35 3.44	1. 24
23	Petrochina Company Limited	中国石油天然气股份有限公司	857 HK	香港联合交易所	香港	1,406,0 00.00	6,405,32 7.56	1. 11
24	Country Garden Holdings Co. Ltd	碧桂园控股有限公司	2007 HK	香港联合交易所	香港	498,000 .00	6,202,61 9.38	1. 07
25	AAC Technologies Holdings Inc	瑞声科技控股有限公司	2018 HK	香港联合交易所	香港	49,000. 00	5,709,76 6.85	0. 99



26	Sands China Ltd	金沙中国有限公司	1928 HK	香港 联合 交易 所	香港	161,200 .00	5,437,10 9.72	0. 94
27	China Overseas Land & Investment Ltd	中国海外发展 有限公司	688 HK	香港 联合 交易 所	香港	256,000 .00	5,381,92 2.94	0. 93
28	Power Assets Holdings Limited	电能实业有限 公司	6 HK	香港 联合 交易 所	香港	92,500. 00	5,099,36 4.47	0. 88
29	WH Group Limited	万洲国际有限 公司	288 HK	香港 联合 交易 所	香港	634,500 .00	4,677,99 4.77	0. 81
30	MTR Corporation Ltd	香港铁路有限 公司	66 HK	香港 联合 交易 所	香港	120,000 .00	4,594,16 1.36	0. 80
31	China Unicom (Hong Kong) Ltd	中国联合网络 通信(香港)股 份有限公司	762 HK	香港 联合	香港	478,000 .00	4,219,40 6.19	0. 73

				交易所				
32	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382 HK	香港联合交易所	香港	48,000.00	4,008,355.63	0.69
33	New World Development Co. Ltd	新世界发展有限公司	17 HK	香港联合交易所	香港	393,000.00	3,856,738.28	0.67
34	China Shenhua Energy Company Limited	中国神华能源股份有限公司	1088 HK	香港联合交易所	香港	226,500.00	3,834,005.71	0.66
35	CITIC Limited	中国中信股份有限公司	267 HK	香港联合交易所	香港	388,000.00	3,658,477.14	0.63
36	China Mengniu Dairy Co. Ltd	中国蒙牛乳业股份有限公司	2319 HK	香港联合交易所	香港	183,000.00	3,556,588.07	0.62
37	China Resources Land	华润置地有限	1109	香	香	184,444	3,546,10	0.

	Limited	公司	HK	港 联 合 交 易 所	港	.00	7.43	61
38	Wharf Real Estate Investment Company Limited	九龙仓置业地产投资有限公司	1997 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	81,000. 00	3,520,85 2.92	0. 61
39	Hengan International Group Company Limited	恒安国际集团有限公司	1044 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	48,000. 00	3,480,72 9.24	0. 60
40	Henderson Land Development Co.Ltd	恒基兆业地产有限公司	12 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	79,812. 00	3,435,85 5.92	0. 59
41	Bank of Communications Co.Ltd	交通银行股份有限公司	3328 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	583,000 .00	2,826,54 6.07	0. 49
42	The Bank of East Asia Limited	东亚银行有限公司	23 HK	香 港 联 合 交 易 所	香 港	90,800. 00	2,569,23 6.26	0. 44

				所				
43	CK Infrastructure Holdings Limited	长江基建集团有限公司	1038 HK	香港联合交易所	香港	44,000.00	2,469,779.69	0.43
44	Sino Land Co.Ltd	信和置业有限公司	83 HK	香港联合交易所	香港	210,000.00	2,429,488.82	0.42
45	Want Want China Holdings Limited	中国旺旺控股有限公司	151 HK	香港联合交易所	香港	417,000.00	2,283,162.78	0.40
46	Hang Lung Properties Ltd	恒隆地产有限公司	101 HK	香港联合交易所	香港	135,000.00	2,155,393.94	0.37
47	Swire Pacific Ltd	太古股份有限公司 A	19 HK	香港联合交易所	香港	33,000.00	1,995,776.92	0.35
48	The Wharf (Holdings) Limited	九龙仓集团有限公司	4 HK	香港联	香港	81,000.00	1,828,135.17	0.32

				合交易所				
49	China Resources Power Holdings Co.Ltd	华润电力控股有限公司	836 HK	香港联合交易所	香港	128,000 .00	1,557,86 8.74	0. 27
50	Lenovo Group Limited	联想集团有限公司	992 HK	香港联合交易所	香港	404,000 .00	1,489,29 0.69	0. 26
51	China Merchants Port Holdings Company Limited	招商局港口控股有限公司	144 HK	香港联合交易所	香港	84,000. 00	1,435,92 6.20	0. 25

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Tencent Holdings Ltd	700 HK	16,396,373.71	1.12
2	HSBC Holdings Plc	5 HK	12,884,948.28	0.88
3	China Construction Bank Corporation	939 HK	11,516,460.78	0.79
4	AIA Group Limited	1299 HK	11,411,166.02	0.78
5	Geely Automobile Holdings Limited	175 HK	9,051,551.82	0.62
6	China Mobile Limited	941	8,308,615.11	0.57

		HK		
7	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	6,512,612.17	0.45
8	Country Garden Holdings Co.Ltd	2007 HK	5,604,454.91	0.38
9	Bank of China Limited	3988 HK	4,963,747.15	0.34
10	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd	2318 HK	4,856,386.24	0.33
11	WH Group Limited	288 HK	4,695,615.73	0.32
12	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	4,437,210.41	0.30
13	CK Hutchison Holdings Limited	1 HK	4,383,009.77	0.30
14	HongKong Exchanges and Clearing Ltd	388 HK	4,218,748.10	0.29
15	WharfReal EstateInvestment Company Limited	1997 HK	3,448,546.86	0.24
16	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	3,031,671.20	0.21
17	Sun Hung Kai Properties Ltd	16 HK	2,630,286.49	0.18
18	CNOOC Limited	883 HK	2,599,413.95	0.18
19	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	2,572,070.86	0.18
20	CLP Holdings Ltd	2 HK	2,548,535.77	0.17

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Tencent Holdings Ltd	700 HK	130,396,188.85	8.93
2	HSBC Holdings Plc	5 HK	89,423,586.40	6.12
3	China Construction Bank Corporation	939 HK	70,369,815.53	4.82
4	AIA Group Limited	1299 HK	69,000,078.21	4.72
5	China Mobile Limited	941 HK	58,091,535.51	3.98
6	Industrial and Commercial Bank	1398	41,519,696.88	2.84

	of China Limited	HK		
7	Bank of China Limited	3988 HK	33,246,744.07	2.28
8	CK Hutchison Holdings Limited	1 HK	28,895,433.78	1.98
9	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd	2318 HK	25,976,889.69	1.78
10	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd	388 HK	25,335,883.09	1.73
11	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	19,303,403.49	1.32
12	CNOOC Limited	883 HK	18,062,261.06	1.24
13	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	17,259,836.76	1.18
14	CK Asset Holdings Limited	1113 HK	16,768,575.35	1.15
15	CLP Holdings Ltd	2 HK	16,739,752.87	1.15
16	Sun Hung Kai Properties Ltd	16 HK	16,667,730.84	1.14
17	Link Real Estate Investment Trust	823 HK	13,830,718.69	0.95
18	Hang Seng Bank Ltd	11 HK	13,691,776.19	0.94
19	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	2388 HK	13,317,583.37	0.91
20	Petro china Company Limited	857 HK	13,003,722.64	0.89

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	160,676,391.72
卖出收入（成交）总额	922,686,101.63

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细**

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

**8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

注：本基金本报告期末未持有基金。

**8.11 投资组合报告附注****8.11.1**

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。

**8.11.2**

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。

**8.11.3 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	101,059.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	79,434.34
4	应收利息	9,485.20
5	应收申购款	1,902,582.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,092,561.83

**8.11.4 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。

**8.11.5 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。



## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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(%)
恒生A	330	452,940.61	141,211,526.00	94.47	8,258,874.00	5.53
恒生B	6,047	24,718.11	6,630,298.00	4.44	142,840,102.00	95.56
添富恒生	19,447	8,374.26	2,907,584.30	1.79	159,946,674.09	98.21
合计	25,824	17,882.40	150,749,408.30	32.64	311,045,650.09	67.36

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

恒生A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	43,219,948.00	28.92
2	工银瑞信基金-农业银行-中油财务有限责任公司	38,152,474.00	25.53
3	中国银河证券股份有限公司	22,402,321.00	14.99
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	17,716,520.00	11.85
5	深圳快快资产管理有 限公司	6,036,350.00	4.04
6	广发基金-招商银行-招商财富资产管理有 限公司	5,949,502.00	3.98
7	上海均直资产管理有 限公司-均直孔最长强 私募证券投资基金	2,921,920.00	1.95

8	平安大华基金-平安银行-平安大华固定收益增强五号特定客户资	1,000,000.00	0.67
9	陈媚	1,000,000.00	0.67
10	南京盛泉恒元投资有限公司-盛泉恒元量化进取多策略1号基金	964,338.00	0.65

恒生 B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	杨继耘	5,501,000.00	3.68
2	廖雪静	5,010,000.00	3.35
3	长江证券-招商银行-长江证券超越理财基金管家 II 集合资产管	4,604,241.00	3.08
4	刘永胜	3,000,000.00	2.01
5	吉烈钧	2,789,200.00	1.87
6	李燕欢	1,849,700.00	1.24
7	李晓岱	1,772,800.00	1.19
8	熊华	1,500,000.00	1.00
9	邢进	1,462,900.00	0.98
10	吴旋玲	1,230,000.00	0.82

添富恒生

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	陈远亮	1,607,968.00	10.43
2	王建新	1,000,000.00	6.49
3	义乌市浪莎小额贷款股份有限公司	971,517.00	6.30
4	南京盛泉恒元投资有限公司-盛泉恒元量化进取多策略1号基金	739,646.00	4.80
5	张卓君	519,594.00	3.37
6	柴庆丰	510,606.00	3.31
7	许宇华	463,259.00	3.01
8	宁波汇创资产管理有 限公司-汇创-霁泽-艾 比之路私募投资基金	386,600.00	2.51
9	黄嵩俊	344,876.00	2.24
10	任晓光	329,227.00	2.14

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管	恒生 A	0.00	0.00

理人所有从业人员持有本基金	恒生 B	0.00	0.00
	添富恒生	141,110.89	0.09
	合计	141,110.89	0.0300

**9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	份额级别	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	恒生 A	0
	恒生 B	0
	添富恒生	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	恒生 A	0
	恒生 B	0
	添富恒生	0
	合计	0

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	恒生 A	恒生 B	添富恒生
基金合同生效日 2014 年 03 月 06 日基金份额总额	109,711,438.00	109,711,438.00	1,051,208,262.98
本报告期期初基金份额总额	596,645,149.00	596,645,149.00	260,769,855.39
本报告期基金总申购份额	-	-	267,867,472.38
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	1,292,826,482.31
本报告期基	-447,174,749.00	-447,174,749.00	927,043,412.93

金拆分变动份额			
本报告期末基金份额总额	149,470,400.00	149,470,400.00	162,854,258.39

注：总申购份额含红利再投份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 《汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年1月25日正式生效，韩贤旺先生任该基金的基金经理。
2. 基金管理人于2017年2月4日公告，增聘欧阳沁春先生和杨璿先生担任汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与韩贤旺先生共同管理该基金。
3. 《汇添富鑫利债券型证券投资基金基金合同》于2017年3月13日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。
4. 基金管理人于2017年3月10日公告，李骁先生任基金管理人副总经理。
5. 《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于2017年3月15日正式生效，顾耀强先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。
6. 基金管理人于2017年3月16日公告，增聘吴江宏先生担任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理，与顾耀强先生共同管理该基金。
7. 《汇添富中国高端制造股票型证券投资基金基金合同》于2017年3月20日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。
8. 《汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2017年4月14日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。
9. 《汇添富精选美元债债券型证券投资基金基金合同》于2017年4月20日正式生效，何旻先生和高欣先生任该基金的基金经理。
10. 《汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2017年4月20日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
11. 《汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2017年4月20日正式生效，

吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。

12. 《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 15 日正式生效，曾刚先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。

13. 基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，聘任郑慧莲女士为汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金和汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

14. 基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理该基金。

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

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

17. 《汇添富添福吉祥混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 7 月 24 日正式生效，何旻先生任该基金的基金经理。

18. 基金管理人于 2017 年 7 月 29 日公告，增聘胡昕炜先生担任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理，与何旻先生共同管理该基金。

19. 《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 8 月 10 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

20. 《汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 8 月 16 日正式生效，刘江先生担任该基金的基金经理。

21. 《汇添富盈润混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 6 日正式生效，何旻先生任该基金的基金经理。

22. 《汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 9 月 6 日正式生效，楚天舒女士任该基金的基金经理。

23. 基金管理人于 2017 年 9 月 8 日公告，增聘陶然先生为汇添富现金宝货币市场基金、汇添富添富通货币市场基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理上述基金。

24. 基金管理人于 2017 年 9 月 21 日公告，增聘胡昕炜先生为汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理，与何旻先生共同管理该基金。

25. 《汇添富民丰回报混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 27 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。

26. 基金管理人于 2017 年 9 月 28 日公告，增聘赵鹏飞先生为汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生共同管理该基金。

27. 《汇添富弘安混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 29 日正式生效，何旻先生和赵鹏飞先生任该基金的基金经理。

28. 《汇添富睿丰混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 29 日正式生效，李怀定先生任该基金的基金经理。

29. 基金管理人于 2017 年 9 月 30 日公告，增聘赵鹏飞先生为汇添富睿丰混合型证券投资基金的基金经理，与李怀定先生共同管理该基金。

30. 《汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 11 月 10 日正式生效，余中强先生和倪健先生任该基金的基金经理。

31. 《汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 11 月 24 日正式生效，赖中立先生任该基金的基金经理。

32. 《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 1 日正式生效，楚天舒女士任该基金的基金经理。

33. 《汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 12 月 4 日正式生效，楚天舒女士任该基金的基金经理。

34. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘董瑾女士为中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金、汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）和汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）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。

35. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理，与何旻先生、曾刚先生共同管理该基金。

36. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘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的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。

37. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与李怀定先生、陆文磊先生、胡娜女士共同管理该基金。

38. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

39. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。

40. 基金管理人于 2017 年 12 月 27 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

41. 基金管理人于 2017 年 12 月 27 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生、蒋文玲女士共同管理该基金。

42. 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

### 11.3 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，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2014 年 3 月 6 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期末，应付未付的审计费用为人民币伍万元整。

### 11.6 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 (%)	
Credit Suisse	-	598,245,363.83	55.22	179,473.69	27.01	-
东方证券	1	485,117,129.52	44.78	485,113.43	72.99	-

#### 11.7.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

11.8 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	2017-01-03
2	关于汇添富恒生指数分级证券投资	中证报, 证券时报,	2017-01-04



	资基金之恒生A份额本次定期折算期间约定年基准收益率的公告	上证报, 公司网站, 深交所	
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下QDII基金2016年年度资产净值的公告	公司网站	2017-01-04
4	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间添富恒生份额、恒生A份额停复牌的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-01-04
5	关于添富恒生份额、恒生A份额定期份额折算后复牌首日前收盘价调整的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-01-05
6	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-01-05
7	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	2017-01-11
8	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	2017-01-13
9	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	2017-01-19
10	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	2017-02-21
11	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	2017-02-23
12	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	2017-02-24
13	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	2017-02-27
14	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	2017-03-02
15	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	2017-03-10
16	汇添富基金管理股份有限公司关	中证报, 证券时报,	2017-03-20

	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	上证报, 公司网站	
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	2017-03-23
18	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	2017-03-23
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	2017-03-23
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	2017-03-29
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	2017-03-30
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	2017-04-11
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	2017-04-11
24	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-04-12
25	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	2017-04-14
26	汇添富恒生指数分级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, 深交所	2017-04-20
27	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	2017-04-22
28	汇添富旗下公募基金 2017 年一季报	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公	2017-04-24

		司网站, 深交所	
29	汇添富基金管理股份有限公司关于分级基金的风险提示公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-04-25
30	汇添富基金管理股份有限公司关于分级基金的风险提示公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-04-26
31	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	2017-04-26
32	汇添富基金管理股份有限公司关于分级基金的风险提示公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-04-27
33	汇添富基金管理股份有限公司关于分级基金的风险提示公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-04-28
34	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-04-28
35	汇添富基金管理股份有限公司关于分级基金的风险提示公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-04-29
36	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	2017-05-03
37	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	2017-05-05
38	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并参加费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-05-25
39	汇添富纯债债券型证券投资基金(LOF)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	2017-06-16
40	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	2017-06-17
41	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手机银行申购、定投基金费率	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-07-01

	优惠活动的公告		
42	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网上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	2017-07-01
43	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2017 年上半年年度资产净值的公告	公司网站	2017-07-03
44	汇添富旗下公募基金 2017 年二季度报	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-07-20
45	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加华泰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	2017-08-01
46	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加华泰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	2017-08-01
47	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中银国际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	2017-08-07
48	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加虹点基金为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-08-11
49	汇添富旗下公募基金 2017 年半年报	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-08-26
50	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加平安银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-09-26
51	汇添富恒生指数分级证券投资基金更新招募说明书(2017 年第 2 号)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-10-21
52	2017 年汇添富旗下基金第 3 季度报告(86 只)	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-10-25
53	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加基煜基金为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-10-26
54	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加伯嘉基金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	2017-11-09
55	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金因境外主要市场节假日暂	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站,	2017-12-21

	停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	深交所	
56	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加南京证券开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-12-22
57	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金办理定期折算业务的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-12-27
58	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017-12-27
59	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手机银行申购、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	2017-12-29
60	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加工商银行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	2017-12-29

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富恒生指数分级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、报告期内汇添富恒生指数分级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。

### 13.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21-23 楼 汇添富基金管理股份有限公司

### 13.3 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  
2018 年 03 月 28 日