

# 汇添富外延增长主题股票型证券投资基金 2015 年半年度报告摘要

2015 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：2015 年 8 月 29 日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富外延增长股票
基金主代码	000925
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 8 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	4,349,647,367.65 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，精选外延增长主题股票，重点挖掘外延式增长的投资机会，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	本基金为股票型基金。投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘通过并购重组活动实现企业外延式增长的上市公司。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+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	蒋松云
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网	www.99fund.com
--------------------	----------------

网址	
基金半年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层汇添富基金管理股份有限公司

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,571,365,399.35
本期利润	2,404,267,273.92
加权平均基金份额本期利润	0.4727
本期基金份额净值增长率	68.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.3806
期末基金资产净值	7,248,151,437.40
期末基金份额净值	1.666

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（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

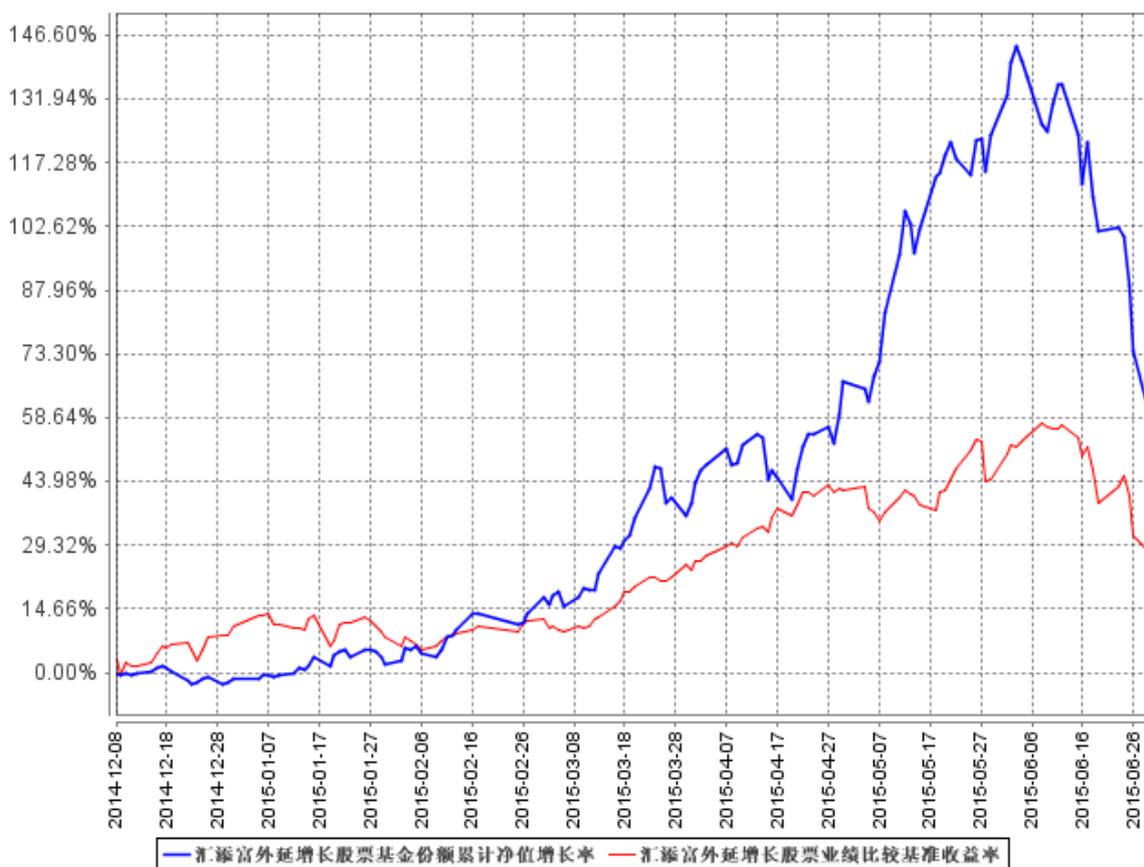
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-25.53%	4.09%	-5.95%	2.80%	-19.58%	1.29%
过去三个月	19.86%	3.63%	8.91%	2.09%	10.95%	1.54%
过去六个月	68.79%	2.93%	21.64%	1.81%	47.15%	1.12%
自基金合同生效日起至 今	66.60%	2.75%	34.37%	1.82%	32.23%	0.93%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2014 年 12 月 08 日，至本报告期末未满 1 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

汇添富外延增长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》生效之日为 2014 年 12 月 08 日，截至本报告期末，基金成立未及一年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2014 年 12 月 08 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，注册资本金为 1 亿元人民币。截止到 2015 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 2,198.54 亿元，有效客户数约 600 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 53 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、汇添富均衡增长股票型证券投资基金、汇添富成长焦点股票型证券投资基金、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、汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富香港优势股票型证券投资基金、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、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、汇添富信用债债券型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、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、汇添富理财 21 天债券型发起式证券投资基金、汇添富消费行业股票型证券投资基金、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 股票型证券投资基金、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、汇添富互利分级债券型证券投资基金、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、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、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。

#### 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		
韩贤旺	汇添富外延增长股票基金、汇添富均衡增长股票基金的	2014 年 12 月 8 日	-	17 年	国籍：中国。学历：复旦大学经济学博士。相关业务资格：

	基金经理， 研究总监。				<p>证券投资基金从业资格。从业经历：曾任君安证券有限责任公司分析师、天同证券有限责任公司研究所所长助理、行业部经理、国联安基金管理有限公司研究主管、平安资产管理有限公司股票研究主管。</p> <p>2007 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司任研究总监，2012 年 3 月 2 日至今任汇添富均衡增长股票基金的基金经理，2014 年 12 月 8 日至今任汇添富外延增长主题股票基金的基金经理。</p>
李威	汇添富外	2015 年 1 月	-	6 年	国籍：中

	<p>延增长股票基金的基金经理、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富双利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的基金经理助理。</p>	<p>29 日</p>		<p>国。学历：清华大学工学硕士。                  相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：                  2008 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司任行业分析师，                  2015 年 1 月 29 日至今任汇添富外延增长股票基金的基金经理。                  2015 年 5 月 25 日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富双利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的基金经理助理。</p>
--	---	-------------	--	--

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

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

聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合，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 1 次，是由于投资流动性的需求导致。经检查和分析未发现异常情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年 A 股市场特征简而言之暴涨暴跌，承接去年底价值股行情，从一月份开始成长股连续领涨，指数在很短的五个月内连创过去数年的新高；但从五月中下旬监管机构提醒场外配资风险开始，市场迅速进入急速下跌修正的阶段，流动性引发的连锁反应发酵，市场持续无量下跌。直

到六月底，这一修正过程还在继续中。

我们认为：过去一年驱动市场的两大主导因素是符合未来经济转型的投资主题和流动性，从今年的特征看，一季度两个因素交叉作用，但是第二个主导因素从二季度开始占据了压倒性的作用。具体而言，五月份杠杆资金推动中小股票爆发式上涨过程中，流动性已经不可或缺的主要力量。监管机构从五月份开始着手清理场外配资，力度非常大，特别是从六月中旬开始，清理力度尤为严厉，对市场产生了明显的挤压作用，前期涨幅过大的板块和股票调整幅度尤为明显。我们认为这是流动性带来的调整和修正，政策干预的方案选择和干预力度将直接决定下一阶段市场走向。

本基金在上半年采用的策略依然是基于自下而上角度挖掘投资主线，主要在重组并购范围内精选个股。本基金的投资品种具备一定的高风险高收益特征，因此在一到五月份取得了比较好的正收益，但是在六月份净值有一定幅度的回撤。本基金在上半年以新兴产业中的优质重组并购股票为主要投资标的，这一策略在一季度取得了比较好的业绩，但是二季度末受到一定冲击。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

上半年沪深 300 指数涨幅为 26.58%，本基金的业绩表现为 68.79%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年宏观经济继续筑底，各项经济指标偏弱的格局不会改变，经济缺乏增长引擎，大量传统产业供大于求的格局依然没有大的改观，经济结构转型和技术创新是主要特征。从供给角度分析，人口红利逐渐弱化，但是人力资源的素质会逐渐提高，资本推动经济增长的潜力逐渐趋稳，技术进步和组织管理创新成为经济增长的主导因素。我们认为中国经济已经进入中等增速阶段。

下半年证券市场需要消化前期去杠杆的冲击，筑底并逐渐寻找新的方向，短期内主要看政府的政策取向和力度，基本面已经变为次要因素。结合成长性和估值综合考虑，我们认为经过这一次调整，一部分股票开始体现出投资价值，而且下半年大概率情况下是一个盘整转折期，也是一个比较好的调整组合结构的阶段。

本基金在下半年重点布局三个方向的投资机会：第一类是有基本面支撑的价值股，主要考虑估值和业绩的稳定性；第二类是以互联网、生命科学和新能源新材料为代表的新兴产业；第三类是改革所带来的各种转型类的投资机会，包括但不限于国企改革、土地改革、户籍制度改革、价格改革。

本基金在下半年主抓三件事：一是适度注重组合的均衡和行业分散配置，自下而上重点挖掘

各种重组并购的标的；二是对现有组合的股票进行筛选和调整，选择的标准是这些品种是否符合未来经济结构调整的趋势；三是选择符合经济结构调整方向的优质蓝筹股。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富外延增长主题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，汇添富外延增长主题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外延增长主题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，汇添富外延增长主题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外延增长主题股票型证券投资基金 2015 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：汇添富外延增长主题股票型证券投资基金  
报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	530,796,213.30	529,874,049.76
结算备付金	46,803,873.92	-
存出保证金	4,284,950.42	-
交易性金融资产	6,801,487,935.60	2,548,188,088.28
其中：股票投资	6,801,487,935.60	2,548,188,088.28
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	-	-
买入返售金融资产	-	2,500,000,000.00
应收证券清算款	346,073,430.83	-
应收利息	124,104.05	3,478,463.30
应收股利	-	-
应收申购款	15,595,691.84	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,745,166,199.96	5,581,540,601.34
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2015年6月30日</b>	<b>2014年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	217,207,089.29
应付赎回款	466,044,664.87	-
应付管理人报酬	15,553,718.52	5,099,989.45
应付托管费	2,592,286.42	849,998.23
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	12,174,454.55	3,106,041.77
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	649,638.20	-
负债合计	497,014,762.56	226,263,118.74
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	4,349,647,367.65	5,427,975,907.41
未分配利润	2,898,504,069.75	-72,698,424.81
所有者权益合计	7,248,151,437.40	5,355,277,482.60
负债和所有者权益总计	7,745,166,199.96	5,581,540,601.34

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.666 元，基金份额总额

4,349,647,367.65 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富外延增长主题股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	2,505,720,401.16
1.利息收入	9,691,874.97
其中：存款利息收入	4,583,253.64
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	5,108,621.33
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,540,264,860.30
其中：股票投资收益	1,532,508,436.37
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	7,756,423.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	832,901,874.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	122,861,791.32
<b>减：二、费用</b>	101,453,127.24
1. 管理人报酬	57,132,122.79
2. 托管费	9,522,020.46
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	34,600,256.53
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	198,727.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	2,404,267,273.92

注：本基金合同于 2014 年 12 月 08 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示本期数据，特此说明。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富外延增长主题股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	5,427,975,907.41	-72,698,424.81	5,355,277,482.60
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	2,404,267,273.92	2,404,267,273.92
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)	-1,078,328,539.76	566,935,220.64	-511,393,319.12
其中：1.基金申购款	12,030,318,455.58	9,751,753,545.94	21,782,072,001.52
2.基金赎回款	-13,108,646,995.34	-9,184,818,325.30	-22,293,465,320.64
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动(净值减少 以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	4,349,647,367.65	2,898,504,069.75	7,248,151,437.40

注：本基金于 2014 年 12 月 08 日成立，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益(基金净值)变动表只列示本期数据，特此说明。

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	陈灿辉	韩从慧
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

汇添富外延增长主题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【2014】1237 号文《关于核准汇添富外延增长主题股票型证券投资基金注册的批复》的核准，由汇添富基金管理股份有限公司作为发起人于 2014 年 12 月 3 日至 2014 年 12 月 4 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具(2014)验字第 60466941\_B34 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 2014 年 12 月 8 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 5,427,563,636.12 元，在募集期间产生

的活期存款利息为人民币 412,271.29 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 5,427,975,907.41 元，折合 5,427,975,907.41 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、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款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投资方法，以基本面分析为立足点，精选外延增长主题股票，重点挖掘外延式增长的投资机会，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。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数×80%+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 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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。

##### 6.4.4.1 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。

#### 6.4.4.2 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。

#### 6.4.4.3 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及贷款和应收款项；

本基金目前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和债券投资。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、存出保证金和各类应收款项等。

##### (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均划分为其他金融负债，主要包括各类应付款项。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

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，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。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取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类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；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，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，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

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；

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。

### 金融资产转移

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。

#### 6.4.4.5 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市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似

投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金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，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得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估值原则仍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，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；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。

#### **6.4.4.7 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份额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。

#### **6.4.4.8 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)”。

#### **6.4.4.9 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) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（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；

(5) 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；

(6) 债券投资收益/（损失）于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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；

(10) 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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（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) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 6.4.4.11 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 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利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；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按除息日除息后的基金份额净值折算成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费；

(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) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，自 2015 年 4 月 3 日起，本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

##### 6.4.5.3 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。

#### 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、企业所得税

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，继续免征营业税和企业所得税；

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。

## 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

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

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

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

## 6.4.7 关联方关系

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

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

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、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
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	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
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富资本管理有限公司	基金管理人施加重大影响的联营企业

### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	8,281,238,338.04	35.03%	-	-

##### 6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易

##### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	2,700,000,000.00	26.46%	-	-

##### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本期末未通过关联方交易单元进行权证交易

**6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	7,373,105.02	34.98%	4,997,455.52	41.05%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
-	-	-	-	-

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

**6.4.8.2 关联方报酬****6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	57,132,122.79
其中：支付销售机构的客户维护费	28,781,511.24	-

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月末，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，顺延至定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内支付。

**6.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,522,020.46	-

注：本基金的托管费按前一日资产净值的 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

基金托管费每日计提，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。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本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。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014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	530,796,213.30	4,136,678.36	-	-

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日获得的利息收入为人民币 369,697.35 元，2015 年半年末结算备付金余额为人民币 46,803,873.92 元。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

## 6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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证券。

### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300377	赢时胜	2015年5月20日	重大事项停牌	187.77	2015年7月15日	168.99	1,602,598	184,582,037.85	300,919,826.46	-
000558	莱茵置业	2015年6月15日	重大事项停牌	32.80	2015年7月13日	29.52	5,118,800	75,557,933.46	167,896,640.00	-
300287	飞利信	2015年6月2日	重大事项停牌	54.26	-	-	3,003,697	126,983,835.67	162,980,599.22	-
002268	卫士通	2015年5月8日	重大事项停牌	80.14	2015年8月4日	76.32	2,003,932	64,369,729.10	160,595,110.48	-
002325	洪涛股份	2015年6月3日	重大事项停牌	31.15	-	-	5,004,383	132,770,574.49	155,886,530.45	-
300383	光环新网	2015年6月17日	重大资产重组停牌	73.08	-	-	2,001,712	145,872,578.68	146,285,112.96	-
002044	江苏三友	2015年6月18日	重大资产重组停牌	55.00	2015年7月1日	49.50	1,551,860	50,544,296.00	85,352,300.00	-
002712	思美传媒	2015年3月19日	重大资产重组停牌	72.86	2015年7月31日	66.10	1,099,941	71,378,197.88	80,141,701.26	-
002170	芭田	2015	重大	26.12	2015	23.51	2,000,000	27,633,432.57	52,240,000.00	-

	股份	年	事项		年					
		5月	停牌		7月					
		26日			28日					
300291	华录百纳	2015年6月30日	重大事项停牌	37.76	2015年7月13日	34.65	734,340	19,745,814.06	27,728,678.40	-
002727	一心堂	2015年4月13日	重大资产重组停牌	82.62	2015年8月17日	70.42	230,310	12,091,081.00	19,028,212.20	-

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	6,801,487,935.60	87.82
	其中：股票	6,801,487,935.60	87.82
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	577,600,087.22	7.46
7	其他各项资产	366,078,177.14	4.73

8	合计	7,745,166,199.96	100.00
---	----	------------------	--------

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	1,487,288,524.99	20.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	155,886,530.45	2.15
F	批发和零售业	327,867,259.51	4.52
G	交通运输、仓储和邮政业	21,605,440.08	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,338,505,852.52	59.86
J	金融业	-	-
K	房地产业	167,896,640.00	2.32
L	租赁和商务服务业	80,141,701.26	1.11
M	科学研究和技术服务业	114,013,520.78	1.57
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	30,669,787.71	0.42
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	27,728,678.40	0.38
S	综合	49,883,999.90	0.69
	合计	6,801,487,935.60	93.84

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300168	万达信息	14,500,000	712,240,000.00	9.83
2	300016	北陆药业	12,499,342	533,846,896.82	7.37
3	300166	东方国信	13,991,787	502,584,989.04	6.93

4	600446	金证股份	3,350,601	413,665,199.46	5.71
5	600570	恒生电子	3,000,000	336,150,000.00	4.64
6	300377	赢时胜	1,602,598	300,919,826.46	4.15
7	000158	常山股份	10,001,761	219,038,565.90	3.02
8	300378	鼎捷软件	2,600,698	211,020,635.72	2.91
9	002175	广陆数测	3,782,700	209,939,850.00	2.90
10	300339	润和软件	4,000,417	192,380,053.53	2.65

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300168	万达信息	627,255,026.79	11.71
2	300016	北陆药业	445,919,178.81	8.33
3	600570	恒生电子	413,658,732.73	7.72
4	600446	金证股份	380,030,958.61	7.10
5	002153	石基信息	370,807,692.40	6.92
6	000158	常山股份	359,278,276.51	6.71
7	002175	东方网络	348,350,950.49	6.50
8	300166	东方国信	294,678,318.92	5.50
9	600850	华东电脑	280,401,673.27	5.24
10	600410	华胜天成	268,573,841.06	5.02
11	300413	快乐购	263,926,469.92	4.93
12	300378	鼎捷软件	259,984,330.45	4.85
13	002049	同方国芯	241,656,543.48	4.51
14	300271	华宇软件	238,459,648.31	4.45
15	300377	赢时胜	209,187,686.96	3.91
16	002439	启明星辰	207,063,589.92	3.87
17	000503	海虹控股	194,283,535.57	3.63
18	300287	飞利信	177,230,581.90	3.31
19	000762	西藏矿业	176,062,866.48	3.29
20	300231	银信科技	175,215,517.17	3.27
21	600260	凯乐科技	170,285,223.16	3.18

22	002030	达安基因	165,051,392.27	3.08
23	002004	华邦颖泰	163,412,432.83	3.05
24	002555	顺荣三七	156,092,092.27	2.91
25	300047	天源迪科	155,008,771.25	2.89
26	300352	北信源	153,696,749.94	2.87
27	000793	华闻传媒	149,203,779.84	2.79
28	300245	天玑科技	146,177,492.23	2.73
29	300383	光环新网	145,872,578.68	2.72
30	002649	博彦科技	139,784,139.81	2.61
31	300209	天泽信息	137,528,773.43	2.57
32	600180	瑞茂通	135,530,745.45	2.53
33	601717	郑煤机	134,162,430.65	2.51
34	002325	洪涛股份	132,770,574.49	2.48
35	002131	利欧股份	130,107,851.60	2.43
36	603729	龙韵股份	122,677,154.33	2.29
37	002197	证通电子	121,394,497.42	2.27
38	600713	南京医药	113,992,379.26	2.13
39	600711	盛屯矿业	110,637,266.54	2.07
40	300012	华测检测	107,635,275.73	2.01
41	300170	汉得信息	107,531,772.53	2.01

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	300059	东方财富	368,053,007.39	6.87
2	601166	兴业银行	367,629,502.82	6.86
3	600570	恒生电子	333,228,097.97	6.22
4	002153	石基信息	311,969,254.28	5.83
5	600410	华胜天成	285,692,107.34	5.33
6	002555	顺荣三七	277,607,698.27	5.18
7	300352	北信源	267,867,329.60	5.00
8	600850	华东电脑	239,677,432.94	4.48
9	600000	浦发银行	218,756,765.24	4.08
10	000503	海虹控股	217,142,697.36	4.05
11	002363	隆基机械	215,910,285.36	4.03

12	600711	盛屯矿业	202,473,519.05	3.78
13	002049	同方国芯	202,309,949.05	3.78
14	601318	中国平安	201,479,809.92	3.76
15	300047	天源迪科	194,839,574.84	3.64
16	000762	西藏矿业	184,728,251.97	3.45
17	300168	万达信息	181,034,567.28	3.38
18	300170	汉得信息	173,882,447.21	3.25
19	300245	天玑科技	171,484,828.48	3.20
20	000158	常山股份	171,059,545.73	3.19
21	002649	博彦科技	165,994,482.26	3.10
22	601717	郑煤机	165,440,794.08	3.09
23	300378	鼎捷软件	146,775,956.50	2.74
24	002170	芭田股份	144,081,423.43	2.69
25	000793	华闻传媒	143,070,409.50	2.67
26	601998	中信银行	132,064,170.18	2.47
27	600048	保利地产	128,052,706.06	2.39
28	300209	天泽信息	124,076,689.47	2.32
29	600446	金证股份	121,768,207.36	2.27
30	600713	南京医药	118,600,791.79	2.21
31	002004	华邦颖泰	114,431,193.00	2.14
32	600180	瑞茂通	110,897,948.59	2.07
33	603729	龙韵股份	107,789,492.50	2.01

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	12,762,623,178.50
卖出股票收入（成交）总额	10,874,733,642.12

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券

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

注：本基金本报告期末未持有债券

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2

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	4,284,950.42
2	应收证券清算款	346,073,430.83

3	应收股利	-
4	应收利息	124,104.05
5	应收申购款	15,595,691.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	366,078,177.14

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300377	赢时胜	300,919,826.46	4.15	重大事项停牌

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
156,215	27,843.98	131,387,199.29	3.02%	4,218,260,168.36	96.98%

### 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	842,487.14	0.02%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	--------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 12 月 8 日）基金份额总额	5,427,975,907.41
本报告期期初基金份额总额	5,427,975,907.41
本报告期基金总申购份额	12,030,318,455.58
减：本报告期基金总赎回份额	13,108,646,995.34
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	4,349,647,367.65

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人 2015 年 1 月 8 日公告，汪洋先生不再担任汇添富中证主要消费 ETF、汇添富中证医药卫生 ETF、汇添富中证能源 ETF、汇添富中证金融地产 ETF 基金的基金经理，由吴振翔先生单独管理上述基金。

2、基金管理人 2015 年 1 月 8 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富深证 300ETF、汇添富深证 300ETF 联接基金的基金经理。同时，汪洋先生不再担任上述基金的基金经理。

3、基金管理人 2015 年 1 月 8 日公告，增聘雷鸣先生担任汇添富蓝筹稳健混合基金的基金经理，与叶从飞先生共同管理该基金。

4、基金管理人 2015 年 1 月 31 日公告，增聘李威先生担任汇添富外延增长股票基金的基金经理，与韩贤旺先生共同管理该基金。

- 5、基金管理人 2015 年 2 月 5 日公告，增聘刘闯先生担任汇添富医疗保健股票基金的基金经理，与周睿先生共同管理该基金。
- 6、《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 16 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。
- 7、基金管理人 2015 年 3 月 11 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财 21 天债券基金的基金经理，与曾刚先生共同管理上述基金。
- 8、基金管理人 2015 年 3 月 11 日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富理财 14 天债券基金的基金经理，与王栩先生共同管理该基金。
- 9、《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基金合同》于 2015 年 3 月 24 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。
- 10、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，陆文磊先生不再担任汇添富收益快线货币基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。
- 11、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，陆文磊先生不再担任汇添富全额宝货币基金的基金经理，由汤从珊女士单独管理该基金。
- 12、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，曾刚先生不再担任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财 21 天债券基金的基金经理，由蒋文玲女士单独管理上述基金。
- 13、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，王栩先生不再担任汇添富理财 14 天债券基金的基金经理，由蒋文玲女士单独管理该基金。
- 14、基金管理人 2015 年 4 月 1 日公告，曾刚先生不再担任汇添富理财 7 天债券基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。
- 15、基金管理人 2015 年 4 月 17 日公告，新任李文先生为董事长，潘鑫军先生不再担任董事长。
- 16、基金管理人 2015 年 4 月 17 日公告，林利军先生不再担任法定代表人和总经理，由李文先生代为履行法定代表人职责，由张晖先生代为履行总经理职责。
- 17、基金管理人 2015 年 5 月 27 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富香港优势股票基金的基金经理，与王致人先生共同管理该基金。
- 18、基金管理人 2015 年 6 月 16 日公告，王致人先生不再担任汇添富香港优势股票基金的基金经理，由赖中立先生单独管理该基金。
- 19、《汇添富医疗服务灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 18 日正式生效，刘江先生任该基金的基金经理。

20、基金管理人 2015 年 6 月 27 日公告，新任李文先生为法定代表人，新任张晖先生为总经理。新任李鹏先生为督察长，李文先生不再担任督察长，张晖先生不再担任副总经理。

21、本报告期，基金托管人中国工商银行股份有限公司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、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

2015 年 1 月，针对上海证监局出具的整改措施，以及对相关负责人的警示，公司高度重视，认真落实整改要求，加强制度和风控措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理能力。

2015 年 4 月，公司已通过上海证监局的检查验收。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	8,281,238,338.04	35.03%	7,373,105.02	34.98%	-
海通证券	2	2,644,577,863.45	11.19%	2,366,644.96	11.23%	-
广发证券	2	2,277,878,673.22	9.64%	2,030,501.10	9.63%	-
光大证券	1	1,870,254,172.23	7.91%	1,654,988.64	7.85%	-
国金证券	2	1,561,465,410.68	6.61%	1,390,295.11	6.60%	-
中信证券	2	1,434,980,437.81	6.07%	1,287,495.88	6.11%	-
国泰君安	2	1,344,201,314.91	5.69%	1,203,936.37	5.71%	-

国信证券	2	1,308,787,433.46	5.54%	1,166,693.05	5.54%	-
中国中投	2	1,151,683,587.84	4.87%	1,035,681.55	4.91%	-
招商证券	2	878,540,849.51	3.72%	781,664.17	3.71%	-
中金公司	2	521,173,495.63	2.20%	461,186.47	2.19%	-
华创证券	1	203,675,139.02	0.86%	180,232.52	0.86%	-
民生证券	1	109,752,072.82	0.46%	99,918.36	0.47%	-
银河证券	1	49,148,032.00	0.21%	44,744.01	0.21%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	-2,700,000,000.00	26.46%	-	-
海通证券	-	-	-2,000,000,000.00	19.60%	-	-
广发证券	-	-	-1,500,000,000.00	14.70%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-2,400,000,000.00	23.52%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中国中投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-1,602,300,000.00	15.71%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

万联证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-

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。

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。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

此 32 个交易单元与汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金共用。本基金本报告期内未新增和减少交易单元。

汇添富基金管理股份有限公司  
2015 年 8 月 29 日