

# 中证金融地产交易型开放式指数证券投资 基金 2015 年半年度报告

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 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

## 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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	42
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	42
7.8 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.....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.12 投资组合报告附注 .....	43
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
8.4 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 .....	44
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>§11 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
11.1 备查文件目录 .....	51
11.2 存放地点 .....	51
11.3 查阅方式 .....	52

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证金融地产 ETF
场内简称	金融 ETF
基金主代码	159931
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 8 月 23 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	79,328,511.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 9 月 16 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要采取完全复制法，在正常市场情况下，日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	中证金融地产指数
风险收益特征	属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本系列基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	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
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288	北京市西城区复兴门内大街 55

	号 6 栋 538 室	号
办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	李文	姜建清

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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	61,962,253.03
本期利润	17,920,395.72
加权平均基金份额本期利润	0.1460
本期加权平均净值利润率	8.51%
本期基金份额净值增长率	7.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	40,159,191.01
期末可供分配基金份额利润	0.5062
期末基金资产净值	142,633,290.08
期末基金份额净值	1.7980
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	79.80%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），

计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

## 3.2 基金净值表现

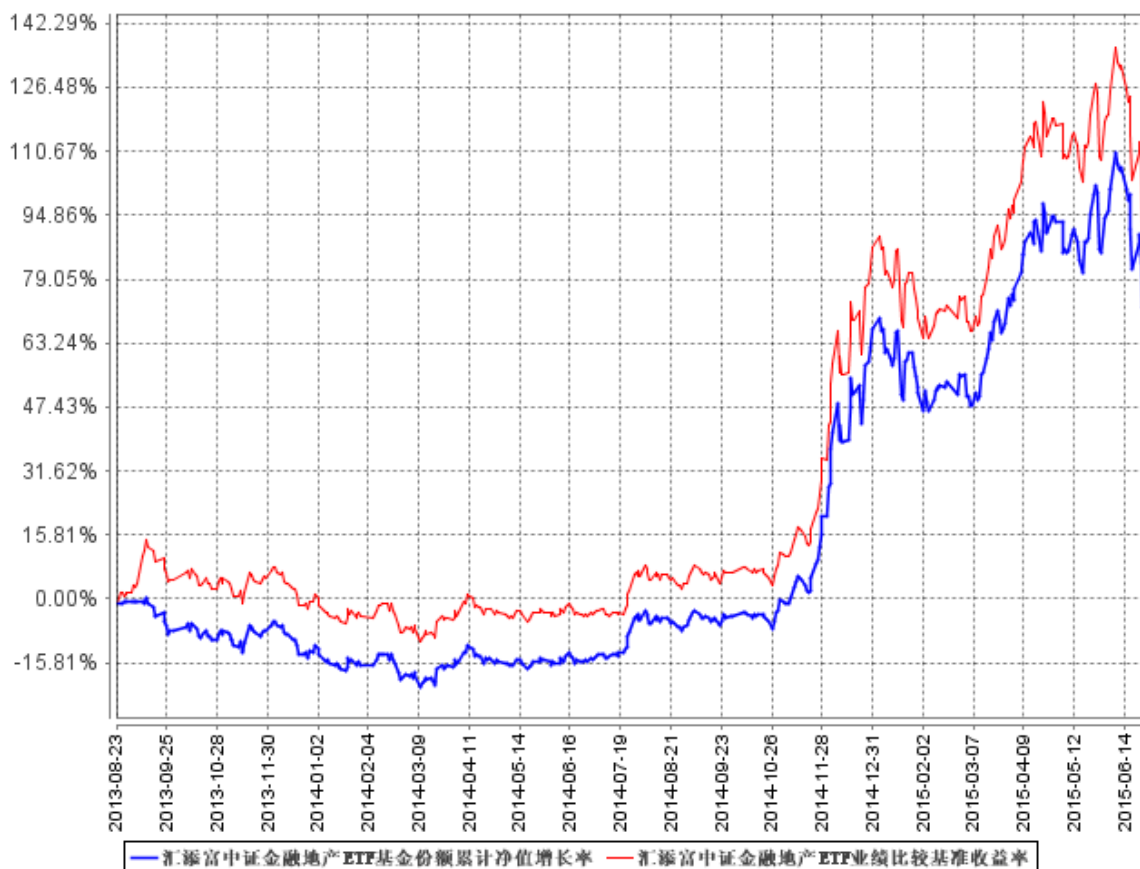
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.11%	3.40%	-3.36%	3.42%	0.25%	-0.02%
过去三个月	4.11%	2.65%	3.69%	2.67%	0.42%	-0.02%
过去六个月	7.84%	2.49%	7.76%	2.51%	0.08%	-0.02%
过去一年	111.08%	2.22%	109.04%	2.24%	2.04%	-0.02%
过去三年	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
过去五年	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
自基金合同生效日起至今	79.80%	1.83%	101.56%	1.88%	-21.76%	-0.05%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2013 年 8 月 23 日，至本报告期末未满 3 年。

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

汇添富中证金融地产ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013年8月23日）起3个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5号文批准，于2005年2月3日正式成立，注册资本金为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、汇添富医疗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		
吴振翔	汇添富上证综合指数、汇添富中证主要消费 ETF、汇添富中证医药卫生 ETF、汇	2013 年 8 月 23 日	-	9 年	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格：证券投资基金从业

	<p>添富中证能源 ETF、汇添富中证金融地产 ETF、汇添富沪深 300 安中指数基金、汇添富成长多因子股票基金、汇添富主要消费 ETF 联接基金的基金经理，指数与量化投资部副总监。</p>			<p>资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 5 日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金的基金经理，2011 年 9 月 28 日</p>
--	--	--	--	---

					<p>至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理，2013 年 8 月 23 日至今任中证主要消费 ETF 基金、中证医药卫生 ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金的基金经理，2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中指数基金的基金经理，2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理，2015 年 3 月 24 日至今任汇添富主要消费 ETF 联接基金的基金经理。</p>
汪洋	汇添富中	2013 年 9 月	2015 年 1 月 6 日	6 年	国籍：中

	<p>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、汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理。</p>	<p>13 日</p>		<p>国。学历：金融工程及计算机科学双硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任华泰联合证券有限责任公司金融工程高级研究员，华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理助理。2013 年 5 月 6 日加入汇添富基金管理股份有限公司，2013 年 9 月 13 日至 2015 年 1 月 6 日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</p>
--	--	-------------	--	--

					理，2013年11月7日至2015年1月6日任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理。
温琪	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、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理助理。	2014年12月23日	-	5年	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011年8月加入汇添富基金，历任金融工程助理分析师，金融工程分析师。2014年12月23日至今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、汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各开放式基金、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

上半年经济仍不见起色，整体处于弱复苏态势。宏观上各项激发实体经济活力的自上而下的改革仍在强有力的推进中，微观经济的活力被进一步激发，“一带一路”、“亚投行”等外部战略让国民看到了大国崛起的雄心和高层的战略视野。一系列改革的鼓舞了市场参与者的乐观情绪，在财富效应带来的增量资金和杠杆的共同作用下，“疯牛”行情持续到了六月上旬。但从六月中旬开始，由于去杠杆和市场情绪的波动，市场进入了由于流动性导致的急跌行情。整体看，杠杆资金的顺周期特性在上半年的暴涨暴跌中扮演了推波助澜的作用。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位报告期内基本保持在 95%~100%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内中证金融指数上涨 7.76%，本基金在报告期内累计收益率为 7.84%，收益率超越业绩比较基准 0.08%。收益率的差异因素主要来源于期间成份股分红、日常申购赎回等因素。本基金日均跟踪误差为 0.0181%，这一跟踪误差水平远低于合同约定上限，在报告期达到了投资目标。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然股市目前面临较大的压力，但引发本轮牛市的经济转型的大背景仍未发生变化。宏观上看，各项国家战略仍在推进。对内，国企改革、区域发展战略、创新驱动发展战略仍在持续激发经济转型潜力；对外，“一带一路”等“走出去”战略仍在有条不紊的推进。微观上，万众创新的激情已被点燃，加之简政放权不断打破以往约束经济活力的条条框框，企业认同转型方向并积极参与其中，涌现了众多充满活力的创新型企业。互联网带来的生产力改进仍在进行中，科技创新仍是中长期市场的关注度。周期上看，目前经济仍存在下行压力，政府不断有新的“稳增长”政策出台，大量的基础设施投资的启动和房地产需求的改善能对实体经济起到良好的托底作用。

目前市场仍在下跌过程中，但场外场内杠杆正在逐步降低，市场估值逐步回归合理，同时监管层的救市举措也能起到一定的安抚市场作用，目前市场悲观情绪可能会在短期稳定下来。由于

这轮暴跌主要由于流动性因素导致，改革牛的大背景仍未发生变化，一旦市场信心恢复，前期超跌的股票会有一定修复行情，但套牢资金也会给市场的反弹造成一定压力，三季度市场可能整体呈现震荡状态。目前市场的估值关注点逐渐从公司的市值空间重新回到公司基本面上，基本面稳固且最受市场关注的大蓝筹标的金融地产行业目前估值合理，会有一定表现。

作为被动投资的指数型基金，汇添富中证金融地产 ETF 将严格遵守基金合同，继续坚持既定的指数化投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、产品创新部、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，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签订了《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：在符合基金收益分配条件的前提下，本基金每年收益分配最多 12 次，收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值。

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，本基金托管人在对中证金融地产交易型开放式指数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，中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在中证金融地产交易型开放式指数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，中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理有限公司编制和披露的中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金 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：中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金  
报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	852,437.60	2,539,691.69
结算备付金		12,584.86	17,071.62
存出保证金		20,682.45	12,616.59

交易性金融资产	6.4.7.2	142,096,764.08	285,882,519.06
其中：股票投资		142,096,764.08	285,882,519.06
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.4	58.33	588.35
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		142,982,527.32	288,452,487.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,087.95	73,328.62
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		66,604.65	89,880.35
应付托管费		13,320.94	17,976.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	33,744.00	42,660.76
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	233,479.70	280,000.00
负债合计		349,237.24	503,845.80
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.8	79,328,511.00	172,704,559.99
未分配利润	6.4.7.9	63,304,779.08	115,244,081.52
所有者权益合计		142,633,290.08	287,948,641.51
负债和所有者权益总计		142,982,527.32	288,452,487.31

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7980 元，基金份额总额 79,328,511.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金

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	附注号	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
<b>一、收入</b>		18,978,611.71	-10,763,482.57
1.利息收入		4,635.08	5,168.09
其中：存款利息收入	6.4.7.10	4,635.08	5,168.09
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		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		62,957,821.46	-16,405,875.45
其中：股票投资收益	6.4.7.11	61,725,116.97	-19,074,468.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,232,704.49	2,668,592.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-44,041,857.31	5,632,070.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	58,012.48	5,154.67
<b>减：二、费用</b>		1,058,215.99	983,492.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	523,880.70	565,142.34
2. 托管费	6.4.10.2.2	104,776.11	113,028.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	145,961.48	44,949.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	283,597.70	260,372.24
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		17,920,395.72	-11,746,975.34
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		17,920,395.72	-11,746,975.34

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金

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)	172,704,559.99	115,244,081.52	287,948,641.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,920,395.72	17,920,395.72
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)	-93,376,048.99	-69,859,698.16	-163,235,747.15
其中：1. 基金申购款	12,000,000.00	7,714,091.37	19,714,091.37
2. 基金赎回款	-105,376,048.99	-77,573,789.53	-182,949,838.52
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)	79,328,511.00	63,304,779.08	142,633,290.08
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	366,328,511.00	-41,770,790.21	324,557,720.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-11,746,975.34	-11,746,975.34
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)	-129,132,269.76	18,368,947.32	-110,763,322.44
其中：1. 基金申购款	14,867,730.24	-2,347,275.45	12,520,454.79
2. 基金赎回款	-144,000,000.00	20,716,222.77	-123,283,777.23
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）	237,196,241.24	-35,148,818.23	202,047,423.01

注： 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

汇添富中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金（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]758号文《关于核准汇添富中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的批复》的核准，由汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）作为发起人于2013年7月15日至2013年8月16日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2013）验字第60466941\_B39号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2013年8月23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536,218,000.00元（不含股票部分），在募集期间产生的活期存款利息为人民币54,119.00元，股票按认购期最后一日的均价计算的净额为人民币211,556,392.00元，以上实收基金（本息）合计为人民币747,828,511.00元，折合747,828,511.00份基金份额。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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金主要采取完全复制法。正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年跟踪误差不超过2%。本基金的业绩比较基准为中证金融地产指数。

### 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制定的《证券

投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于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

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。除以上会计估计的变更，本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 2、营业税、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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	852,437.60
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计:	852, 437. 60

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	106, 005, 264. 42	142, 096, 764. 08	36, 091, 499. 66
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	106, 005, 264. 42	142, 096, 764. 08	36, 091, 499. 66

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

### 6.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	44. 83
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	5. 13
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	8. 37
合计	58. 33

注：“其他”为应收结算保证金利息。

### 6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。



**6.4.7.6 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	33,744.00
银行间市场应付交易费用	-
合计	33,744.00

**6.4.7.7 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	183,479.70
指数使用费	50,000.00
合计	233,479.70

**6.4.7.8 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	172,704,559.99	172,704,559.99
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-105,376,048.99	-105,376,048.99
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	79,328,511.00	79,328,511.00

**6.4.7.9 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,669,046.95	123,913,128.47	115,244,081.52
本期利润	61,962,253.03	-44,041,857.31	17,920,395.72
本期基金份额交易产生的变动数	-13,134,015.07	-56,725,683.09	-69,859,698.16
其中：基金申购款	1,472,900.05	6,241,191.32	7,714,091.37

基金赎回款	-14,606,915.12	-62,966,874.41	-77,573,789.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,159,191.01	23,145,588.07	63,304,779.08

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	3,731.84
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	743.53
其他	159.71
合计	4,635.08

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	16,392,899.60
股票投资收益——赎回差价收入	45,332,217.37
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	61,725,116.97

##### 6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	61,216,454.18
减：卖出股票成本总额	44,823,554.58
买卖股票差价收入	16,392,899.60

##### 6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
----	----------------------------

赎回基金份额对价总额	152,937,004.55
减：现金支付赎回款总额	3,868,715.55
减：赎回股票成本总额	103,736,071.63
赎回差价收入	45,332,217.37

#### 6.4.7.11.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期末有股票投资收益的申购差价收入。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

注：本基金本报告期末有债券投资收益。

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末有资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期末有贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期末投资衍生工具。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,232,704.49
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,232,704.49

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-44,041,857.31
——股票投资	-44,041,857.31
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-44,041,857.31

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	45,019.25
替代损益	12,993.23
合计	58,012.48

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	145,961.48
银行间市场交易费用	-
合计	145,961.48

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	128,931.73
上市年费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
银行费用	118.00
合计	283,597.70

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

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

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
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

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	86,040,926.40	100.00%	33,541,085.93	100.00%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未投资于债券。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期末投资于债券回购。

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末投资于权证。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	77,766.95	100.00%	33,744.00	100.00%
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
东方证券股份	30,298.61	99.84%	22,299.10	99.78%

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

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	523,880.70
其中：支付销售机构的客户维护费	-	0.00

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前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、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	104,776.11	113,028.52

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期未有销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金的基金管理人本报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	40,547.00	0.05%	40,547.00	0.02%

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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	852,437.60	3,731.84	1,631,963.75	3,098.12

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年度上半年度获得的利息收入为人民币743.53元(2014年度可比期间为346.53元)，2015年6月30日结算备付金余额为人民币12,584.86元(2014年度可比期间为6,536.63元)。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

### 6.4.11 利润分配情况

#### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金在本期内及上年度可比期间内均为进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000024	招商地产	2015年4月3日	重大资产重组停牌	31.64	-	-	49,693	925,246.56	1,572,286.52	-
600643	爱建股份	2015年6月30日	重大事项停牌	16.73	-	-	30,737	373,542.58	514,230.01	-
000732	泰禾集团	2015年6月25日	重大事项停牌	34.20	2015年7月2日	30.78	12,103	289,033.56	413,922.60	-



		日								
000979	中弘股份	2015年5月25日	重大资产重组停牌	6.04	-	-	66,243	176,254.29	400,107.72	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本期末及上年度可比期末均未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本期末及上年度可比期末均未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃

而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月- 1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	852,437.60	-	-	-	-	-	852,437.60
结算备付金	12,584.86	-	-	-	-	-	12,584.86
存出保证金	20,682.45	-	-	-	-	-	20,682.45
交易性金融资产	-	-	-	-	-	142,096,764.08	142,096,764.08
应收利息	-	-	-	-	-	58.33	58.33
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	885,704.91	-	-	-	-	142,096,822.41	142,982,527.32
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,087.95	2,087.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	66,604.65	66,604.65
应付托管费	-	-	-	-	-	13,320.94	13,320.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	33,744.00	33,744.00
其他负债	-	-	-	-	-	233,479.70	233,479.70
负债总计	-	-	-	-	-	349,237.24	349,237.24
利率敏感度缺口	885,704.91	-	-	-	-	-141,747,585.17	142,633,290.08
上年度末 2014 年 12 月 31	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

目							
资产							
银行存款	1,631,963.75	-	-	-	-	-	1,631,963.75
结算备付金	6,536.63	-	-	-	-	-	6,536.63
存出保证金	2,984.05	-	-	-	-	-	2,984.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-200,788,267.86	200,788,267.86	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	18,061.16	18,061.16
应收利息	-	-	-	-	-	234.28	234.28
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,641,484.43	-	-	-	-200,806,563.30	202,448,047.73	-
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	17,147.52	17,147.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	84,832.34	84,832.34
应付托管费	-	-	-	-	-	16,966.48	16,966.48
应付交易费用	-	-	-	-	-	22,348.64	22,348.64
其他负债	-	-	-	-	-	259,329.74	259,329.74
负债总计	-	-	-	-	-	400,624.72	400,624.72
利率敏感度缺口	1,641,484.43	-	-	-	-200,405,938.58	202,047,423.01	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期期末计息资产仅包括银行存款，且以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本期期末未持有其他资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014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	142,096,764.08	99.62	285,882,519.06	99.28
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	142,096,764.08	99.62	285,882,519.06	99.28

注：本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产的 90%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表所示。

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金所投资证券的对于上市时间不足一年的股票，使用申银万国行业指数替代股票价格计算其贝塔		
	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（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	5%	6,962,921.03	14,569,743.29
	-5%	-6,962,921.03	-14,569,743.29

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

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	142,096,764.08	99.38
	其中：股票	142,096,764.08	99.38
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	865,022.46	0.60
7	其他各项资产	20,740.78	0.01
8	合计	142,982,527.32	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	116,771,261.98	81.87
K	房地产业	24,178,119.15	16.95
L	租赁和商务服务业	227,127.81	0.16
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	920,255.14	0.65
	合计	142,096,764.08	99.62

## 7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	158,885	13,019,036.90	9.13
2	600036	招商银行	484,079	9,061,958.88	6.35
3	600016	民生银行	834,872	8,298,627.68	5.82
4	600030	中信证券	230,843	6,211,985.13	4.36
5	601166	兴业银行	335,258	5,783,200.50	4.05
6	600000	浦发银行	328,335	5,568,561.60	3.90
7	600837	海通证券	237,319	5,173,554.20	3.63
8	601328	交通银行	575,737	4,744,072.88	3.33
9	000002	万科A	284,544	4,131,578.88	2.90
10	601398	工商银行	728,516	3,846,564.48	2.70
11	601988	中国银行	695,821	3,402,564.69	2.39
12	601169	北京银行	253,631	3,378,364.92	2.37
13	601818	光大银行	597,298	3,201,517.28	2.24
14	601288	农业银行	794,727	2,948,437.17	2.07
15	601601	中国太保	94,296	2,845,853.28	2.00
16	000001	平安银行	171,605	2,495,136.70	1.75
17	601688	华泰证券	107,570	2,488,094.10	1.74
18	600048	保利地产	193,562	2,210,478.04	1.55
19	000166	申万宏源	133,794	2,174,152.50	1.52
20	601939	建设银行	288,084	2,054,038.92	1.44
21	600015	华夏银行	134,153	2,040,467.13	1.43
22	000776	广发证券	88,412	2,002,531.80	1.40
23	600999	招商证券	68,172	1,803,831.12	1.26
24	601377	兴业证券	124,812	1,708,676.28	1.20
25	000024	招商地产	49,693	1,572,286.52	1.10
26	601628	中国人寿	50,173	1,571,418.36	1.10
27	600705	中航资本	67,459	1,561,675.85	1.09
28	601336	新华保险	24,567	1,500,061.02	1.05

29	601901	方正证券	123,352	1,466,655.28	1.03
30	000783	长江证券	101,189	1,411,586.55	0.99
31	000728	国元证券	35,639	1,353,569.22	0.95
32	600109	国金证券	53,310	1,300,764.00	0.91
33	601009	南京银行	54,413	1,240,616.40	0.87
34	601788	光大证券	41,200	1,110,340.00	0.78
35	002142	宁波银行	48,913	1,034,509.95	0.73
36	000402	金融街	71,320	1,007,751.60	0.71
37	600340	华夏幸福	31,794	968,127.30	0.68
38	002673	西部证券	33,706	956,239.22	0.67
39	601099	太平洋	73,815	953,689.80	0.67
40	002736	国信证券	37,877	950,333.93	0.67
41	600383	金地集团	67,726	856,733.90	0.60
42	600369	西南证券	42,044	826,164.60	0.58
43	601555	东吴证券	40,046	819,741.62	0.57
44	601998	中信银行	95,871	739,165.41	0.52
45	000750	国海证券	41,240	692,832.00	0.49
46	600895	张江高科	23,760	691,653.60	0.48
47	002500	山西证券	38,226	691,508.34	0.48
48	000686	东北证券	35,503	691,243.41	0.48
49	600649	城投控股	70,208	656,444.80	0.46
50	000540	中天城投	51,952	654,595.20	0.46
51	600376	首开股份	33,802	652,040.58	0.46
52	000046	泛海控股	41,488	607,799.20	0.43
53	600663	陆家嘴	11,991	596,432.34	0.42
54	600158	中体产业	20,648	591,565.20	0.41
55	002146	荣盛发展	45,674	570,925.00	0.40
56	600208	新湖中宝	72,801	562,023.72	0.39
57	600643	爱建股份	30,737	514,230.01	0.36
58	000031	中粮地产	27,106	512,032.34	0.36
59	000712	锦龙股份	13,400	470,340.00	0.33
60	600816	安信信托	9,123	454,507.86	0.32
61	600675	中华企业	39,699	448,995.69	0.31
62	000616	海航投资	42,602	442,208.76	0.31
63	000732	泰禾集团	12,103	413,922.60	0.29
64	000979	中弘股份	66,243	400,107.72	0.28
65	600240	华业地产	25,241	385,177.66	0.27
66	000006	深振业 A	28,359	384,831.63	0.27
67	000897	津滨发展	39,330	375,208.20	0.26

68	002285	世联行	17,483	374,835.52	0.26
69	000718	苏宁环球	25,408	366,637.44	0.26
70	000667	美好集团	54,216	364,331.52	0.26
71	600325	华发股份	19,896	360,117.60	0.25
72	000656	金科股份	49,868	344,587.88	0.24
73	000671	阳光城	15,689	326,017.42	0.23
74	600064	南京高科	16,273	317,323.50	0.22
75	600067	冠城大通	31,469	312,172.48	0.22
76	002244	滨江集团	16,272	299,567.52	0.21
77	600736	苏州高新	21,864	249,030.96	0.17
78	600747	大连控股	31,066	246,353.38	0.17
79	000926	福星股份	17,235	243,185.85	0.17
80	000620	新华联	17,144	233,501.28	0.16
81	000931	中关村	16,259	228,601.54	0.16
82	000861	海印股份	10,569	227,127.81	0.16
83	000563	陕国投 A	14,843	208,841.01	0.15
84	600823	世茂股份	15,821	206,147.63	0.14
85	600748	上实发展	12,802	200,351.30	0.14
86	600657	信达地产	18,686	153,972.64	0.11
87	600773	西藏城投	8,379	147,554.19	0.10
88	000631	顺发恒业	17,684	143,063.56	0.10
89	600510	黑牡丹	9,120	141,542.40	0.10
90	600743	华远地产	16,875	135,506.25	0.10
91	600639	浦东金桥	455	11,051.95	0.01

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

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

## 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	601988	中国银行	3,584,425.00	1.24
2	600016	民生银行	1,868,603.00	0.65
3	000166	申万宏源	1,833,911.00	0.64



4	601318	中国平安	1,786,318.00	0.62
5	601688	华泰证券	1,677,693.00	0.58
6	601788	光大证券	1,562,006.00	0.54
7	002736	国信证券	1,276,377.00	0.44
8	002673	西部证券	1,265,321.00	0.44
9	601398	工商银行	1,140,687.00	0.40
10	600030	中信证券	1,015,115.00	0.35
11	000001	平安银行	982,437.77	0.34
12	601328	交通银行	965,035.00	0.34
13	601169	北京银行	939,900.00	0.33
14	000046	泛海控股	897,766.00	0.31
15	600705	中航资本	733,477.00	0.25
16	000712	锦龙股份	633,989.12	0.22
17	600109	国金证券	585,770.00	0.20
18	002142	宁波银行	455,918.00	0.16
19	000750	国海证券	333,724.00	0.12
20	601628	中国人寿	266,838.00	0.09

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	5,231,981.38	1.82
2	601318	中国平安	4,878,542.14	1.69
3	600036	招商银行	3,444,975.54	1.20
4	600030	中信证券	2,833,814.68	0.98
5	000001	平安银行	2,490,525.24	0.86
6	600000	浦发银行	2,190,085.51	0.76
7	600837	海通证券	2,178,465.38	0.76
8	601166	兴业银行	2,081,963.37	0.72
9	600383	金地集团	1,667,351.03	0.58
10	000002	万科A	1,613,016.34	0.56
11	601601	中国太保	1,336,065.26	0.46
12	601688	华泰证券	1,245,549.86	0.43
13	002673	西部证券	1,139,062.35	0.40
14	601328	交通银行	1,129,331.67	0.39

15	601818	光大银行	1,034,594.76	0.36
16	601288	农业银行	983,947.67	0.34
17	000783	长江证券	938,153.10	0.33
18	600759	洲际油气	928,318.08	0.32
19	000776	广发证券	927,060.91	0.32
20	600999	招商证券	912,097.40	0.32

注：卖出金额按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	27,692,324.38
卖出股票收入（成交）总额	61,216,454.18

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.7 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：本基金本报告期期末未持有贵金属投资。

### 7.8 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。

### 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：报告期末本基金无国债期货持仓。

### 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	20,682.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	58.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,740.78

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未进行积极投资，不存在流通受限情况。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 本基金的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
2,439	32,525.01	18,522,422.00	23.35%	60,806,089.00	76.65%

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	刘颖	7,889,100.00	9.94%
2	江苏紫鑫投资管理有限公司—恒天紫鑫三号私募证券投资基金	2,784,300.00	3.51%
3	江苏紫鑫投资管理有限公司—紫鑫盈泰二号私募证券投资基金	2,500,000.00	3.15%
4	厦门国际信托有限公司—恒天紫鑫一号证券投资集合资金信托	2,400,000.00	3.03%
5	方正证券股份有限公司	2,047,481.00	2.58%
6	厦门国际信托有限公司—紫鑫五号证券投资集合资金信托计划	2,000,058.00	2.52%
7	刘学平	1,900,055.00	2.40%
8	江苏紫鑫投资管理有限公司—恒天紫鑫二号私募证券投资基金	1,811,600.00	2.28%
9	季滨	1,675,544.00	2.11%
10	中信证券股份有限公司	1,229,360.00	1.55%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年8月23日）基金份额总额	747,828,511.00
本报告期期初基金份额总额	172,704,559.99
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	105,376,048.99
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	79,328,511.00

## §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药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	86,040,926.40	100.00%	77,766.95	100.00%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

兴业证券	1	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-
中投证券	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	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-



民族证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

## 2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

此 39 个交易单元与汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富医药保健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、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、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、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金共用。本报告期内未新增或退租证券公司交易单元。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2014 年年度资产净值的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 1 月 5 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于调整基金经理的公告 (金融 ETF)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 1 月 8 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于设立上海虹桥机场分公司的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 1 月 10 日
4	中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2015 年 1 月 22 日
5	汇添富基金管理股份有限公司北京分公司办公地址变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 31 日
6	中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金 2014 年年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2015 年 3 月 31 日

7	中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金 2014 年年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2015 年 3 月 31 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 4 日
9	中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2015 年第 1 号)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2015 年 4 月 8 日
10	中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要 (2015 年第 1 号)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2015 年 4 月 8 日
11	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 (总经理、法人变更)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 17 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告 (董事长变更)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 17 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于董事会成员变更的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 18 日
14	中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 4 月 21 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于开展现金宝用户销售活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 6 月 5 日
16	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	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 6 月 27 日

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证金融地产交易型开放式指数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、报告期内汇添富中证金融地产交易型开放式指数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。

### **11.2 存放地点**

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理股份有限公司

### **11.3 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  
2015 年 8 月 29 日