

深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告

2015 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 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 2016 年 3 月 25 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 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
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.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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.....	21
§5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
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.....	21
§6 审计报告	22
6.1 审计报告基本信息.....	22
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 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.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
8.6 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.....	61
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	61
8.8 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.....	61

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权证投资明细.....	61
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12 投资组合报告附注	62
§9 基金份额持有人信息.....	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
9.2 期末上市基金前十名持有人	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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.....	64
§10 开放式基金份额变动.....	64
§11 重大事件揭示.....	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
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.....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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.....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	70
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§13 备查文件目录.....	73
13.1 备查文件目录.....	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式.....	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富深证 300ETF
场内简称	深 300ETF
基金主代码	159912
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 16 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	55,948,991.00 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	2011-11-24

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	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%。
业绩比较基准	深证 300 指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，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	洪渊
	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 号 6 栋 538 室	北京市西城区复兴门内大街 55 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 楼 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	44,082,573.02	10,664,233.87	-1,689,561.19
本期利润	25,696,341.13	21,733,151.58	11,749,220.81
加权平均基金份额本期利润	0.4074	0.2206	0.0618
本期加权平均净值利润率	26.56%	23.98%	6.88%
本期基金份额净值增长率	32.55%	30.29%	4.85%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	30,982,548.99	2,263,135.26	-14,287,484.67
期末可供分配基金份额利润	0.5538	0.0322	-0.1004
期末基金资产净值	86,931,539.99	82,464,355.50	128,073,189.42
期末基金份额净值	1.5538	1.1722	0.8997
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	55.38%	17.22%	-10.03%

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

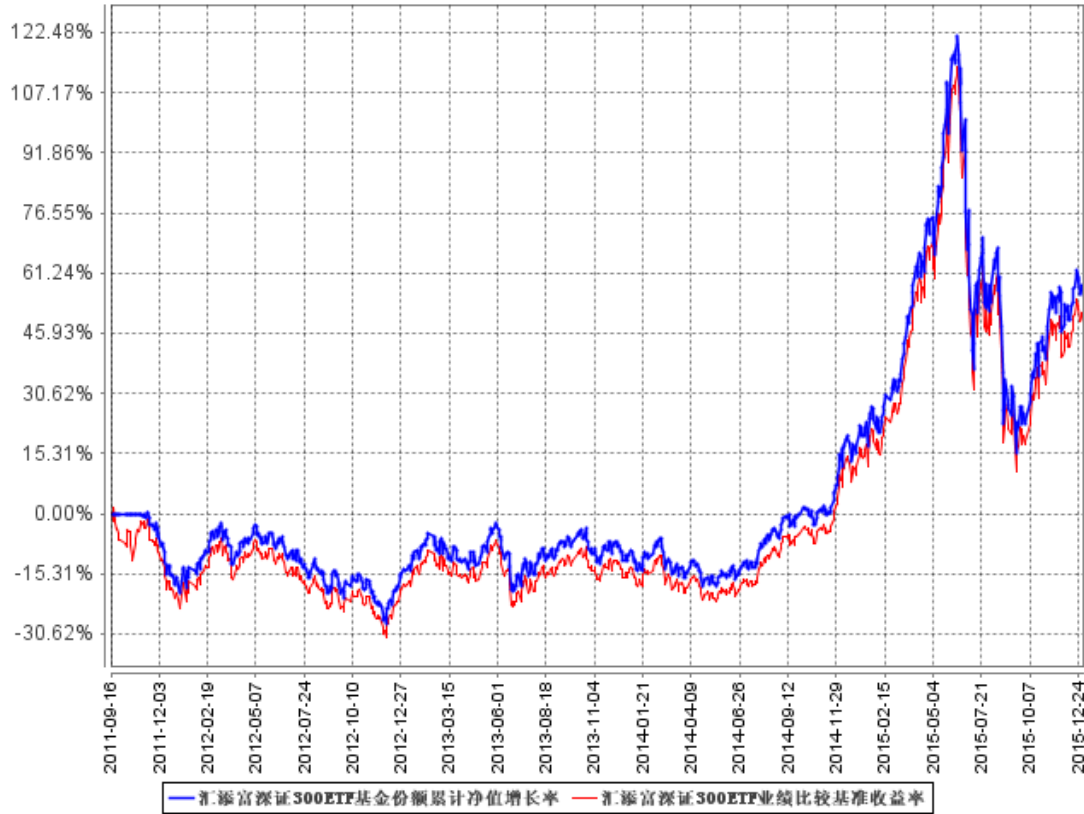
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.54%	1.35%	5.72%	1.35%	-0.18%	0.00%
过去三个月	25.76%	2.03%	25.42%	2.03%	0.34%	0.00%
过去六个月	-12.24%	2.97%	-12.96%	2.97%	0.72%	0.00%
过去一年	32.55%	2.64%	32.63%	2.64%	-0.08%	0.00%
过去三年	81.07%	1.85%	81.43%	1.85%	-0.36%	0.00%
自基金合同 生效日起至 今	55.38%	1.71%	48.45%	1.75%	6.93%	-0.04%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 9 月 16 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

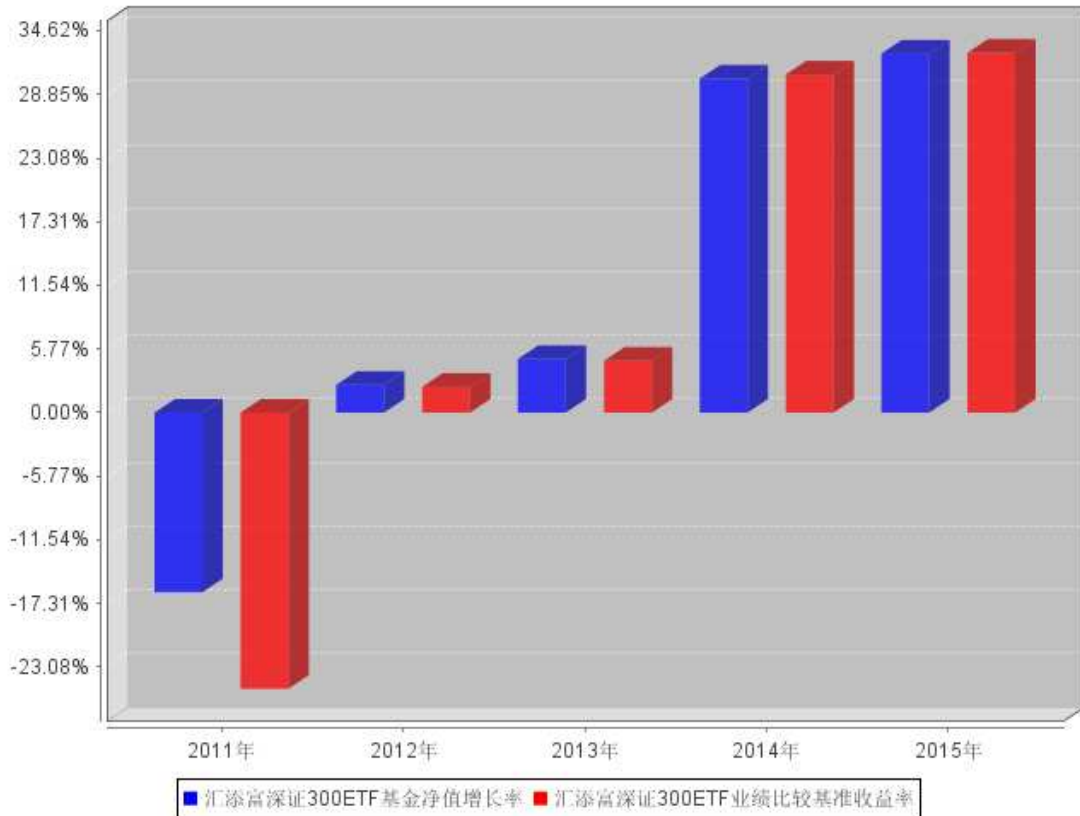
汇添富深证300ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011年9月16日）起3个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

汇添富深证300ETF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对比图



注：1、本基金的《基金合同》生效日为 2011 年 9 月 16 日，至本报告期末未满五年。

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：本基金成立于 2011 年 9 月 16 日，2013 年度至 2015 年度未进行利润分配

§ 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

汇添富基金管理股份有限公司成立于 2005 年 2 月，总部设在上海陆家嘴，公司旗下设立了北京、南方、上海虹桥机场及成都四个分公司，以及两个子公司—汇添富资产管理(香港)有限公司 (China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited) 和汇添富资本管理有限公司。

汇添富是中国第一批获得 QDII 业务资格、专户业务资格、设立海外子公司并且获得 RQFII

业务资格的基金公司，同时是全国社会保障基金投资管理人。截至目前，汇添富已经构建起公募、专户、养老金、国际业务、融资业务及互联网金融六大业务板块协同发展的统一的资产管理服务平台。

汇添富始终坚持“以企业基本分析为立足点,挑选高质量的证券,把握市场脉络,做中长期投资布局,以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益”这一长期价值投资理念,并在投资研究中坚定地贯彻和执行。2015年,汇添富保持了优秀的投资业绩:2015年,公司旗下偏股型基金全年平均涨幅达到71.97%,在大型基金公司当中稳居第一(数据来源:银河基金研究中心)。民营活力、蓝筹稳健和优势精选在同类基金中收益排名前十(数据来源:WIND)。公司中长期投资业绩同样表现十分优秀,旗下权益类基金3年期、5年期整体业绩位居前十五大基金公司之首(数据来源:银河基金研究中心)。

2015年,汇添富基金新发8只基金,包括3只股票型基金,2只指数基金,以及3只混合型基金。其中,添富快钱和现金添富基金分别在深交所和上交所上市,进一步完善了公司场内货基产品线。全年,公司公募基金产品达到58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。

2015年,汇添富基金坚持自有平台与对外合作双面协同发展,互联网金融取得长足进步。截止年底,公司电商平台已与三十余家大型互联网企业开展战略合作,成为迄今为止在电子商务领域对外合作最多的基金公司;公司互联网金融保有量突破1000亿元,客户数量超过1800万人,2015年全年电商平台成交量超过12000亿元,保持行业领先水平。

2015年,汇添富基金机构业务稳步推进。截至年底,公司服务机构客户数量超过200家,资产管理规模同比增长超过150%;公司受托管理19家保险机构的资产委托账户,并于2015年6月,成为社保基金境外配售组合的投资管理人,成为基金行业仅有的两家获得此项资格的机构之一。

2015年,公司积极开展渠道销售和培训工作。优秀的投资业绩、专业的投顾服务以及良好的渠道口碑带来了汇添富品牌影响力的巨大提升。全年,渠道新发基金首募规模在同期发行基金中保持行业领先地位。全年渠道公募保有量同比增长超过100%。

2015年,汇添富基金继续提升客户服务能力,通过持续完善客户平台建设,持续优化电话、短信等服务通道建设,丰富服务渠道,提高客服体验。

2015年,香港子公司国际业务取得重大突破。香港子公司与台湾最大券商签订沪港通投顾合约,与韩国两家排名前十的大型基金管理公司开展投顾合作。此外,公司两地基金互认业务也走在行业前列,截至年底已有3只南下基金获香港证监会销售批准。

2015 年，公司持续加强公益事业建设，践行企业社会责任。8 月，“生命之光”汇添富乡村医生助飞项目启动，公司邀请多位优秀专家深入宁夏泾源县和青海互助县，为当地一线医务工作者提供专业培训指导，并面向农村百姓开展义诊活动。11 月，公司赞助的第 20 届上海国际马拉松赛首度引入公益元素，与“河流·孩子”项目合作，推出“全马完赛公益捐赠”活动，将筹得善款用于改善“河流·孩子”项目学校学生的生活条件。

2015 年，汇添富荣获了包括明星基金奖、金牛基金奖、上海金融创新二等奖、最佳债券公司奖、最佳电子交易平台等多个重要奖项。

2016 年是“十三五”的开局之年，资本市场改革进一步深化，财富管理行业在混业竞争和互联网金融的双重推动下将面临更大的挑战与机遇。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	汇添富上证综合指数的基金经理助理，汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)、汇添富恒生指数分级(QDII)基金、汇添富深证 300ETF、汇添富深证 300ETF 联接基金、汇添富香港优势混合基金(QDII)的基金经理。	2015 年 1 月 6 日	-	8 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：证券投资基金从业资格。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经理，2015年5月26日至今任汇添富香港优势混合基金的基金经理。
过蓓蓓	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	2015年8月18日	-	4年	国籍：中国，学历：中国科学技术大学金融工程博士研究生，相关业务资

	<p>添富中证金融地产ETF、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理。</p>			<p>格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015年6月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理，2015年8月3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、汇添富中证主要消费ETF联接基金的基金经理，2015年8月18日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添</p>
--	---	--	--	---

					富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理。
汪洋	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。	2013 年 11 月 7 日	2015 年 1 月 6 日	6 年	国籍：中国。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	2015 年 8 月 4 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。
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	2015 年 8 月 4 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 2015 年 8 月 4 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、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。公司投资交易行为监控体系由稽核监察部、集中交易室、投资研究部组成，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监控，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他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，利用统计分析的方法和工具，根据对样本个数、差价率是否为0的T检验显著程度、差价率均值是否小于1%、同向交易占优比等原因进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 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5次，其中一次是由于流动性原因，一次是由于合规控制调整原因，三次是因为投资策略原因。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

2015年宏观经济整体偏弱，全年GDP增速破7%降至6.9%。投资增速继续下滑，工业去产能持续，叠加外贸低迷、需求疲弱，拖累经济增长。与此同时，居民消费对经济的支撑作用继续上

升，商品房销售增长拉动建筑装潢、家具等消费品增长。美国进入加息周期，对新兴经济体造成较大的资本外流压力，国际金融风险隐患增多，国内货币政策操作难度加大。资金面、杠杆水平、经济情况的波动给股票市场造成很大影响，全年沪深 300 指数上涨 5.58%，但振幅达到 68.72%，成交金额创历年最高，达到 95.6 万亿元。

本基金在报告期内遵循了 ETF 基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性，股票投资仓位在考察期内始终保持在 95%~100%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。本基金日常管理中非常重视风险管理，对股票和现金头寸严格管理、实时监控，基本实现了 ETF 平稳运作管理的目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内深证 300 指数上涨 32.63%，本基金在报告期内累计收益率为 32.55%，收益率落后业绩比较基准-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 0.0219%，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

全球经济面临需求放缓、发展方式转型、产业结构调整的重大压力。2016 年我国 GDP 增速仍有可能继续温和下行，中央经济工作会议对“供给侧改革”的具体部署表明 2016 年政府“调结构”的目标更加坚定，因此即便经济增速下行、股票市场剧烈波动，只要在底线范围内，政府将不大可能进行大规模干预。结构性改革带来的工业领域的出清、股票市场的去杠杆去泡沫会提速，股票市场估值日趋合理，虽然趋势性的行情难现，但结构性投资机会将较多。

作为被动投资的交易所上市指数型基金，汇添富深证 300ETF 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》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。

4.8 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 12 次，每次收益分配比例依据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的。

本基金本报告期及上年度未进行利润分配。

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

本报告期内，本基金托管人在对深证 300 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，深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在深证 300 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，深证 300 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深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的深证 300 交易型开放式指数证券投资基金财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人汇添富基金管理股份有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）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而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	陈露	蔺育化
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)	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2016 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：深证 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日： 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,840,816.97	1,495,695.02
结算备付金		1,863.04	15,369.04
存出保证金		4,589.96	1,599.55
交易性金融资产	7.4.7.2	85,294,696.35	81,609,823.01
其中：股票投资		85,281,096.35	81,568,986.17
基金投资		-	-
债券投资		13,600.00	40,836.84
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		74,497.91	-
应收利息	7.4.7.5	373.88	208.96
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		87,216,838.11	83,122,695.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	432,733.84
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		37,285.08	36,457.83
应付托管费		7,457.00	7,291.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	15,556.04	16,447.64
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	225,000.00	165,409.20
负债合计		285,298.12	658,340.08
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	55,948,991.00	70,348,991.00
未分配利润	7.4.7.10	30,982,548.99	12,115,364.50
所有者权益合计		86,931,539.99	82,464,355.50
负债和所有者权益总计		87,216,838.11	83,122,695.58

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5538 元，基金份额总额 55,948,991.00 份。

7.2 利润表

会计主体：深证 300 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		26,878,632.73	22,850,010.81
1.利息收入		15,785.23	9,650.19
其中：存款利息收入	7.4.7.11	15,622.84	9,642.96
债券利息收入		162.39	7.23
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）		44,718,008.54	11,622,406.28
其中：股票投资收益	7.4.7.12	43,907,028.84	10,426,256.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	15,782.36	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	795,197.34	1,196,149.35
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-18,386,231.89	11,068,917.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	531,070.85	149,036.63
减：二、费用		1,182,291.60	1,116,859.23
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	481,277.64	453,511.51
2. 托管费	7.4.10.2.2	96,255.55	90,702.28
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	94,600.41	62,450.94
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	510,158.00	510,194.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,696,341.13	21,733,151.58

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：深证 300 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	70,348,991.00	12,115,364.50	82,464,355.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,696,341.13	25,696,341.13
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）	-14,400,000.00	-6,829,156.64	-21,229,156.64
其中：1. 基金申购款	251,200,000.00	178,468,055.53	429,668,055.53
2. 基金赎回款	-265,600,000.00	-185,297,212.17	-450,897,212.17
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）	55,948,991.00	30,982,548.99	86,931,539.99
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	142,348,991.00	-14,275,801.58	128,073,189.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,733,151.58	21,733,151.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-72,000,000.00	4,658,014.50	-67,341,985.50

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	121,600,000.00	-4,473,227.75	117,126,772.25
2.基金赎回款	-193,600,000.00	9,131,242.25	-184,468,757.75
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)	70,348,991.00	12,115,364.50	82,464,355.50

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>陈灿辉</u>	<u>韩从慧</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

深证 300 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[2011]886 号文《关于核准汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开发行募集，基金合同于 2011 年 9 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 521,548,991.00 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%。本基金业绩比较基准为：深证 300 指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于

证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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、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等。

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

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。

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等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。

7.4.4.6 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。

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。

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) 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)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(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。

7.4.4.10 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 0.5% 的年费率计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提；
- (3) 基金的标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，收取下限为每年人民币 30 万元，即若不足人民币 30 万元则按照人民币 30 万元收取；
- (4) 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；
- (5) 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见招募说明书；
- (2) 基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日基金份额净值在扣减每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；
- (3) 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，每次收益分配比例依据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的；
- (4) 本基金收益分配采取现金分红方式；
- (5) 每一基金份额享有同等分配权；
- (6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈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〉的通知》的规定，自 2015 年 4 月 3 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

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

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	1,840,816.97	1,495,695.02
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,840,816.97	1,495,695.02

注：本基金 2015 年度末及 2014 年度末未投资于定期存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	90,007,098.02	85,281,096.35	-4,726,001.67
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	13,600.00	13,600.00
	银行间市场	-	-
	合计	13,600.00	13,600.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	90,020,698.02	85,294,696.35	-4,726,001.67

项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	67,916,592.79	81,568,986.17	13,652,393.38
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	40,836.84	7,836.84
	银行间市场	-	-
	合计	40,836.84	7,836.84
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	67,949,592.79	81,609,823.01	13,660,230.22

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	368.89	186.96
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	0.80	14.07
应收债券利息	2.09	7.23
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	2.10	0.70
合计	373.88	208.96

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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	15,556.04	16,447.64
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	15,556.04	16,447.64

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付审计费	50,000.00	50,000.00
应付信息披露费	100,000.00	30,000.00
应付替代款	-	10,409.20
指数使用费	75,000.00	75,000.00
合计	225,000.00	165,409.20

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,348,991.00	70,348,991.00
本期申购	251,200,000.00	251,200,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-265,600,000.00	-265,600,000.00
- 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	55,948,991.00	55,948,991.00

注：申购含红利再投份额。

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
上年度末	2,263,135.26	9,852,229.24	12,115,364.50
本期利润	44,082,573.02	-18,386,231.89	25,696,341.13
本期基金份额交易产生的变动数	-6,760,351.20	-68,805.44	-6,829,156.64
其中：基金申购款	131,066,141.27	47,401,914.26	178,468,055.53
基金赎回款	-137,826,492.47	-47,470,719.70	-185,297,212.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,585,357.08	-8,602,808.09	30,982,548.99

7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	13,309.14	8,582.09
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	2,255.22	1,044.88
其他	58.48	15.99
合计	15,622.84	9,642.96

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

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12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,646,438.49	619,955.30
股票投资收益——赎回差价收入	42,260,590.35	9,806,301.63
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	43,907,028.84	10,426,256.93

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	29,014,893.75	18,853,598.79
减：卖出股票成本总额	27,368,455.26	18,233,643.49
买卖股票差价收入	1,646,438.49	619,955.30

7.4.7.12.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	450,897,212.17	184,468,757.75
减：现金支付赎回款总额	39,702,093.17	3,510,611.75
减：赎回股票成本总额	368,934,528.65	171,151,844.37
赎回差价收入	42,260,590.35	9,806,301.63

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	48,784.89	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	33,000.00	-
减：应收利息总额	2.53	-
买卖债券差价收入	15,782.36	-

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期末及上期末均未持有贵金属投资。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	795,197.34	1,196,149.35
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	795,197.34	1,196,149.35

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	-18,386,231.89	11,068,917.71
——股票投资	-18,378,395.05	11,061,080.87
——债券投资	-7,836.84	7,836.84
——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	-18,386,231.89	11,068,917.71

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	531,070.85	149,036.63
合计	531,070.85	149,036.63

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31 日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
交易所市场交易费用	94,600.41	62,450.94
银行间市场交易费用	-	-
合计	94,600.41	62,450.94

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
银行划款费用	158.00	194.50
上市年费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	300,000.00	300,000.00
合计	510,158.00	510,194.50

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

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，本基金无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
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
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
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

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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	67,705,610.35	100.00%	43,318,766.32	99.35%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	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 成交总额的 比例
东方证券股份有限公	48,784.89	100.00%	-	-

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回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 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	60,400.63	100.00%	15,556.04	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	38,333.33	99.35%	16,447.64	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 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	481,277.64
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，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。

7.4.10.2 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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	96,255.55	90,702.28

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

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 2 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、公休假等，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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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在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

关联方名称	本期末		上年度末	
	2015 年 12 月 31 日		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	1,034,716.00	1.85%	0.00	0.00%

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	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 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
中国工商银行股份有限公司	1,840,816.97	13,309.14	1,495,695.02	8,582.09

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 年度获得的利息收入为人民币 2,255.22 元(2014 年度：人民币 1,044.88 元)，2015 年末结算备付金余额为人民币 1,863.04 元(2014 年末：人民币 15,369.04 元)。

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

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015 年 12 月 21 日	2016 年 1 月 8 日	新债未上市	100.00	100.00	136	13,600.00	13,600.00	-

7.4.12.2 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
000002	万科 A	2015 年 12 月 18 日	重大资产重组停牌	24.43	-	-	157,698	2,361,926.22	3,852,562.14	-
300104	乐视网	2015 年 12 月 7 日	重大资产重组停牌	58.80	-	-	17,873	1,013,122.45	1,050,932.40	-
002465	海格通信	2015 年 12 月 30 日	重大事项停牌	16.69	2016 年 2 月 4 日	15.02	27,530	469,609.77	459,475.70	-
002065	东华软件	2015 年 12 月 21 日	重大事项停牌	25.10	-	-	15,330	455,054.99	384,783.00	-
000712	锦龙股	2015 年 12 月 25 日	重大事项	29.12	2016 年 1 月 4 日	28.00	12,853	386,806.92	374,279.36	-

份	停牌									
000876	新希望	2015 年 8 月 17 日	重大资产重组停牌	18.99	2016 年 3 月 2 日	17.09	18,403	360,278.31	349,472.97	-
002049	同方国芯	2015 年 12 月 11 日	重大资产重组停牌	60.15	2016 年 3 月 11 日	54.14	4,961	221,485.32	298,404.15	-
002340	格林美	2015 年 12 月 29 日	重大事项停牌	15.20	2016 年 1 月 6 日	14.35	19,428	296,669.43	295,305.60	-
002219	恒康医疗	2015 年 7 月 8 日	重大资产重组停牌	14.90	-	-	19,395	306,011.83	288,985.50	-
000748	长城信息	2015 年 6 月 18 日	重大资产重组停牌	34.88	2016 年 3 月 10 日	31.39	6,070	197,860.25	211,721.60	-
000901	航天科技	2015 年 8 月 19 日	重大资产重组停牌	52.88	2016 年 2 月 18 日	47.59	4,002	215,393.39	211,625.76	-
000028	国药一致	2015 年 10 月 20 日	重大资产重组停牌	66.15	-	-	3,155	233,926.93	208,703.25	-
300088	长信科技	2015 年 12 月 14 日	重大资产重组停牌	14.03	2016 年 2 月 29 日	12.63	14,774	177,906.10	207,279.22	-
300043	互动娱乐	2015 年 12 月 17 日	重大事项停牌	15.80	-	-	9,851	143,452.79	155,645.80	-
002011	盾安环境	2015 年 12 月 28 日	重大事项停牌	16.72	2016 年 2 月 22 日	15.05	9,152	143,958.90	153,021.44	-
000829	天音控股	2015 年 11 月 9 日	重大资产重组停牌	12.22	-	-	10,844	174,337.16	132,513.68	-
002048	宁波华翔	2015 年 11 月 19 日	重大资产重组停牌	17.40	-	-	7,434	161,979.20	129,351.60	-
000982	中银绒业	2014 年 8 月 25 日	重大事项停牌	4.64	2016 年 2 月 25 日	5.10	7,687	35,556.15	35,667.68	-
002313	日海通讯	2015 年 8 月 10 日	重大事项停牌	14.80	2016 年 1 月 22 日	13.90	48	995.13	710.40	-

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

截至本报告期末 2015 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

截至本报告期末 2015 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。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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。

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，除在附注 7.4.12 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。

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、债券投资、结算备付金及存出保证金等

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	1,840,816.97	-	-	-	-	-	1,840,816.97
结算备付金	1,863.04	-	-	-	-	-	1,863.04
存出保证金	4,589.96	-	-	-	-	-	4,589.96
交易性金融资产	-	-	13,600.00	-	-	85,281,096.35	85,294,696.35
应收证券清算款	-	-	-	-	-	74,497.91	74,497.91
应收利息	-	-	-	-	-	373.88	373.88
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,847,269.97	-	13,600.00	-	-	85,355,968.14	87,216,838.11
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	37,285.08	37,285.08
应付托管费	-	-	-	-	-	7,457.00	7,457.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	15,556.04	15,556.04
其他负债	-	-	-	-	-	225,000.00	225,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	285,298.12	285,298.12
利率敏感度缺口	1,847,269.97	-	13,600.00	-	-	85,070,670.02	86,931,539.99
上年度末 2014 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	1,495,695.02	-	-	-	-	-	1,495,695.02
结算备付金	15,369.04	-	-	-	-	-	15,369.04
存出保证金	1,599.55	-	-	-	-	-	1,599.55
交易性金融资产	-	-	-	-	40,836.84	81,568,986.17	81,609,823.01
应收利息	-	-	-	-	-	208.96	208.96
资产总计	1,512,663.61	-	0.00	-	40,836.84	81,569,195.13	83,122,695.58
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	430,435.21	430,435.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	36,457.83	36,457.83
应付托管费	-	-	-	-	-	7,291.57	7,291.57
应付交易费用	-	-	-	-	-	16,447.64	16,447.64
其他负债	-	-	-	-	-	167,707.83	167,707.83
负债总计	-	-	-	-	-	658,340.08	658,340.08
利率敏感度缺口	1,512,663.61	-	0.00	-	40,836.84	80,910,855.05	82,464,355.50

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交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金持有的可转债的市场风险在附注 7.4.13.4.3.2 中进行披露；除此之外，本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金及存出保证金，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，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 2015 年 12 月 31 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	85,281,096.35	98.10	81,568,986.17	98.91
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	13,600.00	0.02	40,836.84	0.05
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	85,294,696.35	98.12	81,609,823.01	98.96

注：本基金投资组合中股票投资比例范围为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。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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与所投资证券的贝塔系数密切相关；		
	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系数；		
	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12月31日）	上年度末（2014年12月31日）
	深证300指数上涨5%	4,326,034.56	4,094,822.18
	深证300指数下跌5%	-4,326,034.56	-4,094,822.18

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。

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2015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76,480,655.10元，属于第二层次的余额为人民币8,814,041.25元，无第三层次余额。（于2014年12月31日，属于第一层次的余额为人民币76,919,083.11元，属于第二层次的余额为人民币4,690,739.90元，无第三层次余额）。

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债券，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债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈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〉的通知》的规定,自 2015 年 4 月 3 日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值,相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

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 2016 年 3 月 25 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	85,281,096.35	97.78
	其中:股票	85,281,096.35	97.78
2	固定收益投资	13,600.00	0.02
	其中:债券	13,600.00	0.02
	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	1,842,680.01	2.11
7	其他各项资产	79,461.75	0.09
8	合计	87,216,838.11	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	911,578.76	1.05
B	采矿业	1,264,040.28	1.45
C	制造业	45,614,812.15	52.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,599,711.02	1.84
E	建筑业	1,208,503.33	1.39
F	批发和零售业	2,339,010.19	2.69
G	交通运输、仓储和邮政业	100,836.76	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,588,810.57	12.18
J	金融业	6,955,475.42	8.00
K	房地产业	7,611,671.73	8.76
L	租赁和商务服务业	2,182,922.89	2.51
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,628,679.38	1.87
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	368,359.58	0.42
R	文化、体育和娱乐业	2,504,110.89	2.88
S	综合	402,573.40	0.46
	合计	85,281,096.35	98.10

8.2.2 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

8.3 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

8.3.1 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	000002	万科 A	157,698	3,852,562.14	4.43
2	000651	格力电器	79,548	1,777,897.80	2.05
3	000001	平安银行	110,284	1,322,305.16	1.52
4	000725	京东方 A	412,208	1,224,257.76	1.41
5	000333	美的集团	35,838	1,176,203.16	1.35
6	300104	乐视网	17,873	1,050,932.40	1.21
7	300059	东方财富	19,578	1,018,643.34	1.17
8	000776	广发证券	50,692	985,959.40	1.13
9	002024	苏宁云商	72,925	980,841.25	1.13
10	000858	五粮液	30,868	842,079.04	0.97
11	002450	康得新	21,561	821,474.10	0.95
12	002415	海康威视	21,983	755,995.37	0.87
13	000063	中兴通讯	38,783	722,527.29	0.83
14	000783	长江证券	56,499	701,717.58	0.81
15	002304	洋河股份	9,283	636,256.82	0.73
16	000100	TCL 集团	148,415	632,247.90	0.73
17	002202	金风科技	27,483	626,337.57	0.72
18	000166	申万宏源	58,023	621,426.33	0.71
19	000625	长安汽车	35,881	608,900.57	0.70
20	002594	比亚迪	9,193	592,029.20	0.68
21	300024	机器人	8,420	576,770.00	0.66
22	002673	西部证券	17,494	575,727.54	0.66
23	300027	华谊兄弟	13,333	553,052.84	0.64
24	002230	科大讯飞	14,690	544,264.50	0.63
25	300070	碧水源	10,300	533,231.00	0.61
26	001979	招商蛇口	25,510	532,138.60	0.61
27	000538	云南白药	7,258	527,075.96	0.61
28	002183	怡亚通	11,405	525,314.30	0.60
29	000917	电广传媒	19,573	519,858.88	0.60
30	002241	歌尔声学	14,695	508,447.00	0.58
31	000069	华侨城 A	57,681	507,592.80	0.58
32	000768	中航飞机	19,920	493,418.40	0.57
33	002736	国信证券	24,875	491,281.25	0.57
34	000423	东阿阿胶	9,300	486,390.00	0.56
35	300017	网宿科技	8,056	483,279.44	0.56
36	000559	万向钱潮	20,523	464,435.49	0.53
37	002142	宁波银行	29,855	463,051.05	0.53

38	002465	海格通信	27,530	459,475.70	0.53
39	000402	金融街	38,780	447,133.40	0.51
40	000728	国元证券	19,171	433,072.89	0.50
41	000793	华闻传媒	28,318	425,619.54	0.49
42	000157	中联重科	79,543	425,555.05	0.49
43	000503	海虹控股	12,050	403,554.50	0.46
44	000009	中国宝安	22,415	402,573.40	0.46
45	002456	欧菲光	12,838	398,234.76	0.46
46	002466	天齐锂业	2,800	394,100.00	0.45
47	300124	汇川技术	8,268	390,249.60	0.45
48	002065	东华软件	15,330	384,783.00	0.44
49	000623	吉林敖东	12,416	384,275.20	0.44
50	300168	万达信息	11,588	383,910.44	0.44
51	002252	上海莱士	9,574	380,757.98	0.44
52	002292	奥飞动漫	7,324	378,724.04	0.44
53	000630	铜陵有色	105,135	376,383.30	0.43
54	000061	农产品	21,270	376,266.30	0.43
55	000338	潍柴动力	38,762	374,440.92	0.43
56	000712	锦龙股份	12,853	374,279.36	0.43
57	000839	中信国安	18,384	374,114.40	0.43
58	002153	石基信息	2,446	369,346.00	0.42
59	002008	大族激光	14,240	368,673.60	0.42
60	000686	东北证券	20,903	365,802.50	0.42
61	002236	大华股份	9,678	357,118.20	0.41
62	002405	四维图新	9,196	356,804.80	0.41
63	000876	新希望	18,403	349,472.97	0.40
64	000826	启迪桑德	8,721	345,526.02	0.40
65	300058	蓝色光标	22,948	338,024.04	0.39
66	300315	掌趣科技	24,008	336,112.00	0.39
67	000895	双汇发展	16,318	333,050.38	0.38
68	300003	乐普医疗	8,603	332,075.80	0.38
69	000060	中金岭南	23,432	328,750.96	0.38
70	002030	达安基因	7,952	327,463.36	0.38
71	000413	东旭光电	35,865	325,654.20	0.37
72	000977	浪潮信息	10,218	324,012.78	0.37
73	000425	徐工机械	75,998	322,991.50	0.37
74	000568	泸州老窖	11,822	320,612.64	0.37
75	000750	国海证券	24,656	316,829.60	0.36
76	000963	华东医药	3,798	311,284.08	0.36

77	002475	立讯精密	9,692	309,659.40	0.36
78	002500	山西证券	19,949	304,022.76	0.35
79	002400	省广股份	12,036	302,705.40	0.35
80	000540	中天城投	32,976	300,741.12	0.35
81	002049	同方国芯	4,961	298,404.15	0.34
82	000661	长春高新	2,458	296,066.10	0.34
83	002340	格林美	19,428	295,305.60	0.34
84	002129	中环股份	23,929	292,412.38	0.34
85	000039	中集集团	13,772	289,212.00	0.33
86	002219	恒康医疗	19,395	288,985.50	0.33
87	002739	万达院线	2,400	288,000.00	0.33
88	000997	新大陆	11,310	286,369.20	0.33
89	000012	南玻 A	21,388	285,529.80	0.33
90	002081	金螳螂	15,148	282,964.64	0.33
91	002439	启明星辰	8,820	282,240.00	0.32
92	002385	大北农	22,925	279,914.25	0.32
93	000566	海南海药	7,138	277,382.68	0.32
94	000415	渤海金控	30,606	276,066.12	0.32
95	002004	华邦健康	19,188	271,510.20	0.31
96	000792	盐湖股份	10,476	269,023.68	0.31
97	002276	万马股份	8,900	267,890.00	0.31
98	000998	隆平高科	11,248	267,140.00	0.31
99	300253	卫宁健康	6,328	265,016.64	0.30
100	002701	奥瑞金	9,355	264,372.30	0.30
101	000709	河钢股份	78,200	260,406.00	0.30
102	300079	数码视讯	21,382	259,149.84	0.30
103	000031	中粮地产	18,206	255,794.30	0.29
104	002007	华兰生物	5,801	255,244.00	0.29
105	000656	金科股份	48,213	254,564.64	0.29
106	002368	太极股份	3,720	249,612.00	0.29
107	002152	广电运通	8,005	248,074.95	0.29
108	000046	泛海控股	19,618	246,205.90	0.28
109	000410	沈阳机床	9,839	246,171.78	0.28
110	000938	紫光股份	2,500	245,950.00	0.28
111	000718	苏宁环球	18,611	245,479.09	0.28
112	000887	中鼎股份	10,396	245,345.60	0.28
113	300144	宋城演艺	8,587	243,012.10	0.28
114	000078	海王生物	10,137	242,882.52	0.28
115	300251	光线传媒	8,003	242,410.87	0.28

116	002573	清新环境	10,799	242,329.56	0.28
117	000629	攀钢钒钛	65,740	241,265.80	0.28
118	002038	双鹭药业	7,128	238,788.00	0.27
119	000581	威孚高科	9,577	237,126.52	0.27
120	300033	同花顺	3,332	236,738.60	0.27
121	000988	华工科技	11,146	236,072.28	0.27
122	000738	中航动控	7,448	235,505.76	0.27
123	002280	联络互动	3,800	233,320.00	0.27
124	000547	航天发展	12,133	231,133.65	0.27
125	000800	一汽轿车	14,117	231,095.29	0.27
126	002191	劲嘉股份	15,039	230,999.04	0.27
127	300002	神州泰岳	17,494	229,171.40	0.26
128	000831	五矿稀土	11,062	228,983.40	0.26
129	000598	兴蓉环境	31,993	227,790.16	0.26
130	300077	国民技术	4,938	223,098.84	0.26
131	000930	中粮生化	15,000	221,700.00	0.26
132	000511	烯碳新材	18,922	221,576.62	0.25
133	002104	恒宝股份	9,135	219,148.65	0.25
134	300072	三聚环保	6,417	217,985.49	0.25
135	000697	炼石有色	7,791	216,745.62	0.25
136	002470	金正大	10,642	216,458.28	0.25
137	000050	深天马 A	10,203	216,405.63	0.25
138	000400	许继电气	11,072	215,128.96	0.25
139	000690	宝新能源	21,973	214,895.94	0.25
140	300133	华策影视	7,206	214,666.74	0.25
141	002353	杰瑞股份	8,411	213,471.18	0.25
142	002422	科伦药业	11,416	212,337.60	0.24
143	000970	中科三环	15,105	211,923.15	0.24
144	000748	长城信息	6,070	211,721.60	0.24
145	000901	航天科技	4,002	211,625.76	0.24
146	002657	中科金财	2,632	210,533.68	0.24
147	002261	拓维信息	5,400	210,060.00	0.24
148	002161	远望谷	9,366	208,861.80	0.24
149	300170	汉得信息	10,518	208,782.30	0.24
150	000028	国药一致	3,155	208,703.25	0.24
151	002312	三泰控股	7,503	208,583.40	0.24
152	300088	长信科技	14,774	207,279.22	0.24
153	002266	浙富控股	25,419	206,910.66	0.24
154	000878	云南铜业	14,923	206,683.55	0.24

155	300001	特锐德	7,100	205,900.00	0.24
156	002022	科华生物	7,038	204,805.80	0.24
157	000627	天茂集团	19,015	204,601.40	0.24
158	002491	通鼎互联	10,500	203,490.00	0.23
159	002146	荣盛发展	21,305	203,036.65	0.23
160	002310	东方园林	7,658	202,630.68	0.23
161	000778	新兴铸管	31,086	201,748.14	0.23
162	000883	湖北能源	32,843	201,656.02	0.23
163	000516	国际医学	9,157	201,454.00	0.23
164	002467	二六三	9,545	200,349.55	0.23
165	300291	华录百纳	5,600	199,360.00	0.23
166	000156	华数传媒	6,040	198,112.00	0.23
167	000592	平潭发展	9,867	197,142.66	0.23
168	002273	水晶光电	4,844	196,666.40	0.23
169	300244	迪安诊断	2,828	196,659.12	0.23
170	300216	千山药机	4,400	193,952.00	0.22
171	002410	广联达	10,653	193,671.54	0.22
172	000027	深圳能源	19,669	192,952.89	0.22
173	300147	香雪制药	7,693	192,401.93	0.22
174	002424	贵州百灵	7,461	191,449.26	0.22
175	300146	汤臣倍健	4,944	190,344.00	0.22
176	002179	中航光电	4,968	188,585.28	0.22
177	300055	万邦达	8,679	188,421.09	0.22
178	002642	荣之联	3,252	188,258.28	0.22
179	000006	深振业 A	16,334	188,004.34	0.22
180	300257	开山股份	6,075	187,413.75	0.22
181	002095	生意宝	2,519	185,373.21	0.21
182	000671	阳光城	20,505	185,160.15	0.21
183	002489	浙江永强	17,000	184,280.00	0.21
184	002073	软控股份	10,844	183,263.60	0.21
185	002665	首航节能	6,000	183,000.00	0.21
186	002250	联化科技	9,687	182,793.69	0.21
187	002375	亚厦股份	11,527	181,780.79	0.21
188	300267	尔康制药	5,400	181,440.00	0.21
189	000875	吉电股份	19,700	181,043.00	0.21
190	000999	华润三九	6,612	180,507.60	0.21
191	000939	凯迪生态	12,501	180,014.40	0.21
192	000667	美好集团	36,146	179,284.16	0.21
193	300085	银之杰	3,200	178,880.00	0.21

194	300274	阳光电源	6,472	177,462.24	0.20
195	002223	鱼跃医疗	4,584	176,254.80	0.20
196	000729	燕京啤酒	21,276	175,101.48	0.20
197	001696	宗申动力	12,593	174,035.26	0.20
198	000541	佛山照明	10,368	173,145.60	0.20
199	300166	东方国信	5,400	172,962.00	0.20
200	002005	德豪润达	16,965	172,025.10	0.20
201	300015	爱尔眼科	5,437	171,700.46	0.20
202	000786	北新建材	14,344	170,693.60	0.20
203	300273	和佳股份	8,158	170,502.20	0.20
204	002055	得润电子	4,400	170,104.00	0.20
205	002294	信立泰	5,602	168,732.24	0.19
206	002474	榕基软件	6,995	167,530.25	0.19
207	300199	翰宇药业	6,800	167,484.00	0.19
208	000960	锡业股份	12,425	167,240.50	0.19
209	000616	海航投资	21,201	166,639.86	0.19
210	002063	远光软件	7,720	163,200.80	0.19
211	000979	中弘股份	40,544	162,176.00	0.19
212	000816	智慧农业	19,397	161,770.98	0.19
213	000983	西山煤电	26,570	161,545.60	0.19
214	000758	中色股份	10,808	160,823.04	0.19
215	300498	温氏股份	3,500	160,090.00	0.18
216	002092	中泰化学	18,033	158,690.40	0.18
217	000777	中核科技	5,043	158,299.77	0.18
218	000021	深科技	13,078	157,720.68	0.18
219	000825	太钢不锈	38,465	157,706.50	0.18
220	002311	海大集团	11,194	156,380.18	0.18
221	002299	圣农发展	7,099	156,107.01	0.18
222	002501	利源精制	12,396	155,941.68	0.18
223	002130	沃尔核材	6,800	155,856.00	0.18
224	300043	互动娱乐	9,851	155,645.80	0.18
225	002185	华天科技	8,679	155,614.47	0.18
226	300032	金龙机电	5,100	155,040.00	0.18
227	002428	云南锗业	7,640	154,939.20	0.18
228	300212	易华录	3,353	154,808.01	0.18
229	300026	红日药业	7,312	154,283.20	0.18
230	000543	皖能电力	18,163	153,840.61	0.18
231	002011	盾安环境	9,152	153,021.44	0.18
232	300115	长盈精密	4,541	152,441.37	0.18

233	002001	新和成	8,508	148,379.52	0.17
234	002050	三花股份	13,794	146,906.10	0.17
235	002168	深圳惠程	12,416	146,881.28	0.17
236	002074	国轩高科	3,959	146,878.90	0.17
237	002390	信邦制药	10,000	143,500.00	0.17
238	002051	中工国际	5,653	143,190.49	0.16
239	002555	顺荣三七	2,900	141,694.00	0.16
240	002429	兆驰股份	11,147	141,455.43	0.16
241	000681	视觉中国	3,680	139,876.80	0.16
242	002440	闰土股份	7,318	139,407.90	0.16
243	002195	二三四五	3,756	138,972.00	0.16
244	002498	汉缆股份	18,600	138,384.00	0.16
245	000158	常山股份	6,800	138,380.00	0.16
246	002052	同洲电子	9,423	138,046.95	0.16
247	002318	久立特材	9,000	137,700.00	0.16
248	000685	中山公用	9,663	136,731.45	0.16
249	300202	聚龙股份	4,224	135,970.56	0.16
250	002190	成飞集成	3,083	134,912.08	0.16
251	002570	贝因美	9,035	134,892.55	0.16
252	002285	世联行	8,256	133,994.88	0.15
253	002013	中航机电	5,851	132,583.66	0.15
254	000829	天音控股	10,844	132,513.68	0.15
255	000897	津滨发展	23,045	131,356.50	0.15
256	000851	高鸿股份	8,349	130,494.87	0.15
257	000652	泰达股份	18,243	130,072.59	0.15
258	002477	雏鹰农牧	7,684	129,936.44	0.15
259	002048	宁波华翔	7,434	129,351.60	0.15
260	002396	星网锐捷	5,346	129,105.90	0.15
261	002437	誉衡药业	4,266	129,046.50	0.15
262	000751	锌业股份	19,900	127,758.00	0.15
263	000572	海马汽车	19,952	127,692.80	0.15
264	000732	泰禾集团	5,200	127,400.00	0.15
265	002138	顺络电子	8,800	126,280.00	0.15
266	002269	美邦服饰	18,760	125,879.60	0.14
267	300226	上海钢联	2,478	125,634.60	0.14
268	002151	北斗星通	2,399	125,179.82	0.14
269	002344	海宁皮城	8,152	125,051.68	0.14
270	000861	海印股份	16,000	123,680.00	0.14
271	300005	探路者	5,330	122,057.00	0.14

272	002522	浙江众成	6,500	120,445.00	0.14
273	300039	上海凯宝	8,642	119,778.12	0.14
274	002106	莱宝高科	8,942	119,286.28	0.14
275	002681	奋达科技	2,727	119,169.90	0.14
276	002399	海普瑞	3,332	117,852.84	0.14
277	002625	龙生股份	2,400	116,760.00	0.13
278	000062	深圳华强	3,131	114,594.60	0.13
279	002603	以岭药业	6,280	113,856.40	0.13
280	000898	鞍钢股份	23,754	113,306.58	0.13
281	000528	柳工	13,569	112,487.01	0.13
282	000539	粤电力 A	15,073	110,786.55	0.13
283	002563	森马服饰	8,800	109,120.00	0.13
284	002155	湖南黄金	12,086	108,653.14	0.13
285	002029	七匹狼	7,932	108,430.44	0.12
286	300134	大富科技	3,531	106,283.10	0.12
287	000961	中南建设	6,856	105,993.76	0.12
288	002431	棕榈园林	3,857	103,521.88	0.12
289	000401	冀东水泥	9,490	103,441.00	0.12
290	300157	恒泰艾普	8,379	102,307.59	0.12
291	000088	盐田港	11,698	100,836.76	0.12
292	300433	蓝思科技	1,200	100,056.00	0.12
293	000937	冀中能源	18,790	94,701.60	0.11
294	000975	银泰资源	7,328	91,746.56	0.11
295	000693	华泽钴镍	4,521	84,226.23	0.10
296	300052	中青宝	2,819	81,722.81	0.09
297	002203	海亮股份	6,733	74,063.00	0.09
298	002653	海思科	3,058	66,939.62	0.08
299	000982	中银绒业	7,687	35,667.68	0.04
300	000869	张裕 A	74	3,387.72	0.00
301	000596	古井贡酒	83	3,029.50	0.00
302	000550	江铃汽车	77	2,308.46	0.00
303	002056	横店东磁	79	2,220.69	0.00
304	000860	顺鑫农业	99	2,108.70	0.00
305	000762	西藏矿业	77	2,025.10	0.00
306	002028	思源电气	99	1,573.11	0.00
307	002181	粤传媒	77	1,220.45	0.00
308	002041	登海种业	69	1,162.65	0.00
309	002277	友阿股份	55	763.95	0.00
310	002313	日海通讯	48	710.40	0.00

8.3.2 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000725	京东方 A	1,539,607.00	1.87
2	002736	国信证券	650,973.00	0.79
3	300144	宋城演艺	632,535.00	0.77
4	000001	平安银行	598,668.00	0.73
5	000661	长春高新	519,724.00	0.63
6	002400	省广股份	473,348.00	0.57
7	000503	海虹控股	444,163.00	0.54
8	300104	乐视网	435,670.50	0.53
9	002439	启明星辰	414,382.00	0.50
10	002466	天齐锂业	397,677.83	0.48
11	000547	航天发展	387,705.00	0.47
12	300168	万达信息	377,213.00	0.46
13	002273	水晶光电	372,682.00	0.45
14	300251	光线传媒	372,378.00	0.45
15	300133	华策影视	369,257.00	0.45
16	000712	锦龙股份	354,554.00	0.43
17	002594	比亚迪	348,931.00	0.42
18	000938	紫光股份	343,900.00	0.42
19	000156	华数传媒	335,068.00	0.41
20	000930	中粮生化	334,803.00	0.41

8.4.2 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	000001	平安银行	733,600.57	0.89
2	000166	申万宏源	685,698.92	0.83

3	000651	格力电器	680,259.47	0.82
4	002415	海康威视	506,486.90	0.61
5	000661	长春高新	422,345.68	0.51
6	000002	万科 A	410,412.12	0.50
7	000333	美的集团	315,104.12	0.38
8	002681	奋达科技	311,299.34	0.38
9	000513	丽珠集团	309,628.04	0.38
10	000938	紫光股份	266,734.88	0.32
11	002024	苏宁云商	266,164.36	0.32
12	300027	华谊兄弟	265,665.58	0.32
13	002153	石基信息	259,508.70	0.31
14	000069	华侨城 A	252,352.39	0.31
15	000625	长安汽车	251,315.02	0.30
16	300059	东方财富	234,990.19	0.28
17	000762	西藏矿业	227,644.82	0.28
18	002261	拓维信息	224,110.77	0.27
19	002123	荣信股份	219,013.12	0.27
20	000858	五粮液	211,178.66	0.26

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。

8.4.3 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	40,839,688.14
卖出股票收入（成交）总额	29,014,893.75

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	13,600.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	13,600.00	0.02
----	----	-----------	------

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123001	蓝标转债	136	13,600.00	0.02

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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

8.12.2

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。

8.12.3 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	4,589.96
2	应收证券清算款	74,497.91
3	应收股利	-
4	应收利息	373.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,461.75

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000002	万科 A	3,852,562.14	4.43	重大资产重组停牌
2	300104	乐视网	1,050,932.40	1.21	重大资产重组停牌

8.12.5.2 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。

§ 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

9.1.1 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
1,208	46,315.39	41,616,649.00	74.38%	14,332,342.00	25.62%

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
中国工商银行-汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	39,119,142.00	69.92%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行-汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据

9.2 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	中国工商银行股份有限公司-汇添富深证 300 交易型开放式指数证	39,119,142.00	69.92%
2	东方证券股份有限公司	1,034,716.00	1.85%
3	北京无限立通通讯技术有限责公司	708,499.00	1.27%
4	苗桂玲	700,000.00	1.25%
5	王仰东	682,500.00	1.22%
6	杨卓兴	489,903.00	0.88%
7	海通国际控股有限公司-客户资金（交易所）	489,500.00	0.87%
8	沈东来	404,814.00	0.72%
9	凌蔚盈	390,000.00	0.70%
10	彭志红	330,000.00	0.59%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金的基金管理人从业人员本报告期末未持有本基金。

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	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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年9月16日）基金份额总额	521,548,991.00
本报告期期初基金份额总额	70,348,991.00
本报告期基金总申购份额	251,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	265,600,000.00
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	55,948,991.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有举行基金份额持有人大会。

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、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混合基金的基金经理，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混合基金的基金经理，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混合基金的基金经理，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、基金管理人 2015 年 7 月 18 日公告，增聘吴江宏先生担任汇添富可转债债券基金的基金经理，与曾刚、梁珂先生共同管理该基金。

22、《汇添富国企创新股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 10 日正式生效，李威先生、劳杰男先生任该基金的基金经理。

23、基金管理人 2015 年 7 月 24 日公告，梁珂先生不再担任汇添富可转债债券基金的基金经理，由曾刚先生、吴江宏先生管理该基金。

24、基金管理人 2015 年 7 月 31 日公告，叶从飞先生不再担任汇添富蓝筹稳健混合基金的基金经理，由雷鸣先生单独管理该基金；汤从珊女士不再担任汇添富和聚宝货币基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

25、基金管理人 2015 年 8 月 5 日公告，朱晓亮先生不再担任汇添富均衡增长混合基金的基金经理，由韩贤旺先生、叶从飞先生、顾耀强先生管理该基金。

26、基金管理人 2015 年 8 月 5 日公告，增聘过蓓蓓女士担任汇添富消费 ETF、金融 ETF、能源 ETF、医药 ETF、消费 ETF 联接基金的基金经理，与吴振翔先生共同管理该基金。

27、基金管理人 2015 年 8 月 6 日公告，经汇添富基金管理股份有限公司第二届董事会第三次会议决议，公司聘任袁建军先生为公司副总经理。

28、《汇添富民营新动力股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 7 日正式生效，谭志强先生任该基金的基金经理。

29、基金管理人 2015 年 8 月 19 日公告，增聘过蓓蓓女士担任汇添富深 300ETF、深 300ETF 联接基金的基金经理，与赖中立先生共同管理该基金。

30、基金管理人 2015 年 8 月 29 日公告，陈加荣先生不再担任汇添富信用债债券基金的基金经理，由何旻先生单独管理该基金。

31、基金管理人 2015 年 10 月 29 日公告，增聘倪健先生担任汇添富香港优势混合基金的基金经理，与赖中立先生共同管理该基金。

32、基金管理人 2015 年 11 月 3 日公告，吴振翔先生不再担任汇添富消费 ETF、金融 ETF、能源 ETF、医药 ETF 基金的基金经理，由过蓓蓓女士单独管理该基金。

33、基金管理人 2015 年 11 月 19 日公告，增聘劳杰男先生担任汇添富价值精选混合基金的基金经理，与陈晓翔先生共同管理该基金。

34、基金管理人 2015 年 11 月 19 日公告，增聘李怀定先生担任汇添富季季红定期开放债券

基金、互利分级债券基金的基金经理，与陆文磊先生共同管理上述基金。

35、《汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 11 月 26 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

36、基金管理人 2015 年 11 月 26 日公告，增聘许一尊先生担任汇添富成长多因子量化策略股票基金的基金经理，与吴振翔先生共同管理该基金。

37、《汇添富新兴消费型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 2 日正式生效，雷鸣先生、刘伟林先生任该基金的基金经理。

38、《汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 2 日正式生效，李怀定先生任该基金的基金经理。

39、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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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（2011 年 9 月 16 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付当期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

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。

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	

东方证券	2	67,705,610.35	100.00%	60,400.63	100.00%	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中国建银投资	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

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	
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
东方证券	48,784.89	100.00%	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投资	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金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、此 38 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、中证金融地产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、汇添富中证主要消费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、中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）共用。本报告期内退租 1 家证券公司的 1 个交易单元：华宝证券（上交所交易单元）。

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 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（深 300ETF）	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	深证 300 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关于旗下部分基金调整停牌股票估	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管	2015 年 2 月 12 日

	值方法的公告（东方财富）	理人网站	
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告（万达信息、信邦制药、天龙集团）	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 3 月 3 日
7	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
8	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2014 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
9	深证 300 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
10	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
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	深证 300 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, 深交所	2015 年 4 月 21 日
15	深证 300 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 25 日
16	深证 300 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 25 日
17	关于深证 300 交易型开放式指数证券投资基金暂停一级市场赎回业务的公告（网站披露）	管理人网站	2015 年 6 月 1 日
18	关于深证 300 交易型开放式指数证券投资基金暂停及恢复一级市场赎回业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2015 年 6 月 2 日
19	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

20	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
21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2015 年上半年资产净值的公告 (网站披露)	管理人网站	2015 年 7 月 1 日
22	汇添富基金管理股份有限公司关于公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 7 月 6 日
23	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 2 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 7 月 18 日
24	汇添富基金管理股份有限公司关于设立成都分公司的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2015 年 8 月 6 日
25	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)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2015 年 8 月 6 日
26	汇添富基金管理股份有限公司关于调整基金经理的公告 (深 300ETF)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2015 年 8 月 19 日
27	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加天天基金网费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2015 年 8 月 22 日
28	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年半年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2015 年 8 月 29 日
29	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年半年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站, 深交所	2015 年 8 月 29 日
30	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加盈米财富为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 10 月 13 日
31	深证 300 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 2 号)	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 管理人网站	2015 年 10 月 23 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

-

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准深证 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《深证 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《深证 300 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、报告期内深证 300 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。

13.2 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

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 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
2016 年 3 月 29 日