

汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)2 016年半年度报告摘要

2016-06-30

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：2016-08-27

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富黄金及贵金属(QDII-LOF-FOF)
场内简称	添富贵金
基金主代码	164701
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011-08-31
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	321,611,425.24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	2012-03-01

注：本基金为LOF基金，在深交所的简称为“添富贵金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	深入研究影响黄金及其他贵金属(如白银、铂金、钯金等)价格的主要因素，把握不同品种贵金属的长期价格趋势和短期市场波动，通过主动投资于有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF)，在严格控制风险的前提下，力争基金收益率超越同期黄金价格走势。
投资策略	综合考虑国际政治、经济、汇市、战争、主要国家货币和利率政策、贵金属市场供求等多方面因素，本基金重点投资于境外上市有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF)，长期持有结合动态调整。本基金主要投资策略包括贵金属资产配置策略、交易所交易基金(ETF)投资策略、货币市场工具投资策略以及金融衍生工具投资策略。
业绩比较基准	伦敦金价格折成人民币后的收益率 (伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix)，人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。)
风险收益特征	本基金为基金中基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，主要投资于境外有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF)，其预期风险收益水平与黄金价格相似。

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

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	布朗兄弟哈里曼银行
	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
注册地址		140 Broadway New York, NY 10005

办公地址	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码	NY 10005

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

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

§ 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(2016年01月01日-2016年06月30日)
本期已实现收益	-4,804,013.80
本期利润	43,143,692.36
加权平均基金份额本期利润	0.1263
本期基金份额净值增长率	24.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.4234
期末基金资产净值	207,493,796.19
期末基金份额净值	0.645

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

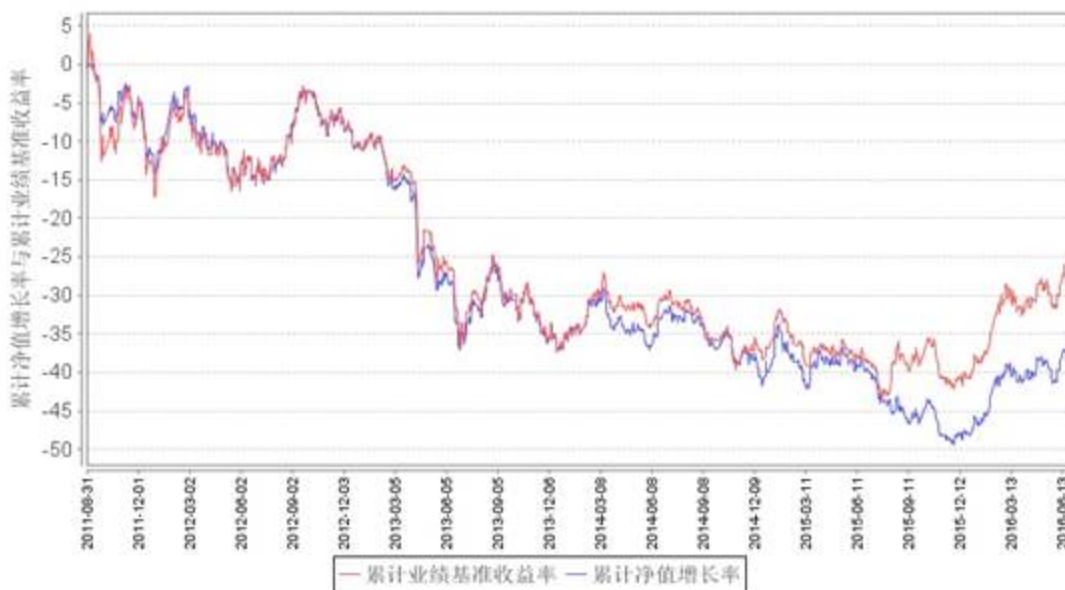
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.51%	1.34%	9.83%	1.42%	0.32%	0.08%
过去三个月	8.95%	1.05%	9.58%	1.13%	0.63%	0.08%
过去六个月	24.76%	1.08%	27.24%	1.19%	2.48%	0.11%
过去一年	6.79%	1.01%	22.34%	1.10%	15.55%	0.09%
过去三年	0.78%	0.97%	18.92%	1.00%	18.14%	0.03%
成立以来	-35.50%	1.01%	-24.84%	1.12%	10.66%	0.11%

注：本基金的《基金合同》生效日为2011年8月31日，至本报告期末未满五年。

3.2.2

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

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011年8月31日）起6个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5号文批准，于2005年2月3日正式成立，注册资本金为11762.2978万元人民币。截止到2016年6月30日，公司管理证券投资基金规模约2857亿元，有效客户数约1200万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理63只开放式证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长混合型证券投资基金、汇添富成长焦点混合型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富民营活力混合型证券投资基金、汇添富香港优势混合型证券投资基金、汇添富医

药保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证300交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富6月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、汇添富理财30天债券型证券投资基金、汇添富理财60天债券型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富优选回报混合型证券投资基金、汇添富消费行业混合型证券投资基金、汇添富理财7天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽30混合型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富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、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富成长多因子量化策略股票基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务混合型证券投资基金、汇添富国企创新增长股票型证券投资基金、汇添富民营新动力股票型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富新兴消费股票型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金、汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富盈安保本混合型证券投资基金、汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赖中立	汇添富黄金及贵金属基金(LOF)的基金经理、汇添富恒生指数分级(QDII)基金、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富香港优势精选混合基金的基金经理。	2012-11-01		9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股份有限公司，历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属基金(LOF)的基金经理，2014年3月6日至今任汇添富恒生指数分级(QDII)基金的基金经理，2015年1月6日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理，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。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年上半年，全球黄金市场经历了较大幅度上扬，纽约Comex金价从2015年12月底的1060美元大幅上涨至2016年6月底的1320美元，涨幅为24.53%。2016年一季度，美联储在去年12月中旬宣布加息后，贵金属市场利空出尽，加之人民币贬值

压力释放出尽，黄金价格呈现较大幅度的反弹。同时投资者对全球经济增长乏力的担忧以及全球金融市场动荡引发黄金的避险需求上升。受今年以来美国经济数据出现反复，美联储近期加息概率较低，以及全球金融市场信心尚未恢复，金价一季度表现强势，加之2月中国春节期间，需求较为旺盛，多方面因素推动黄金价格持续走高。2016年二季度，全球市场最为关注的便是英国脱欧的进程，六月底英国公投，脱欧投票人数远超预期，英国脱欧这一黑天鹅事件持续发酵，欧洲经济复苏进程被大大降缓。美联储亦收到国际经济形势与国内摇摆不定的经济数据的影响，迟迟不能打开新一轮的加息窗口。全球经济复苏的摇摆无疑增加了黄金的避险需求。同时全球央行持续进行黄金的购入，印度、中国等黄金消费大国的需求明显改善，推动了二季度黄金价格的持续攀升。

整个上半年，本基金采取了相对较高的仓位，获得了较好的收益。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金上半年上涨24.76%，同期基准上涨27.24%，超额收益为-2.48%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年黄金投资，最主要需要关注全球经济增长与货币政策特别是美国货币政策。一般而言，在经济增长较为强劲的区间，投资者风险偏好会上升，投资者更愿意配置股票等高收益风险资产，以期获得较好的依托于经济增长的回报，而黄金作为非生息资产，其投资的吸引力将显著降低；但在经济增长放缓甚至收缩的过程中，风险类资产并不能创造价值，相反会毁灭价值，在这种情况下，投资黄金至少能有较好的避险功能，黄金的吸引力将上升。而从另一个方面来讲，通胀或者货币发行也密切影响了黄金的表现。黄金最重要的功能是价值尺度的功能，而各国印发的一张张钞票无疑也是一般等价物商品，在全球超发货币情况下，黄金没办法超发，作为价值锚定的作用将会具有显著的投资吸引力。过去五年，美国GDP与货币平均增长率为3.7%和7%，欧元区为1.87%和3.9%，日本为0.69%和3.3%，我国为10.67%和14%，全球主要经济体超发了大量货币。但是我们看到，过去几年黄金的表现并不是很好，一方面原因是市场预期美国经济好转，并有美联储加息预期持续

压制，资金涌入美国股票等风险资产；另一方面资金持续流入房产等市场，也大幅推高了房地产市场的价格。但随着美元正式进入加息周期，市场发现美国经济仍有反复，全球经济复苏的逻辑也一再被证伪，而作为一般认为无风险资产的美国国债，也因为美国持续多年的超发货币变得不那么避险了，市场对黄金的关注度持续升高。展望下半年的经济走势与货币政策，我们认为全球经济复苏仍较遥远，以往的全球经济增长引擎中国也遇到了一定的困难，同时以往全球超发的货币将寻找新的资金出口，风险资产的吸引力下降将挤出较大量的资金对无风险资产进行配置。而全球超发的货币的后果也将逐渐显露其结果——

通胀。在经济不振、通胀抬头的情况下，全球经济更加靠近滞胀，此时是黄金资产的配置良机。美国加息进程预计不会停止，但全球其余经济体持续货币宽松，而全球通胀抬头，过往的无风险资产不再保险。因此我们预计2016年黄金表现将好于美元无风险资产或货币，而美元货币表现将好于人民币等其他经济体货币，而风险资产在接近滞胀的经济态势下降表现最差。总的来看，在较长期范围内我们对黄金价格仍抱有较乐观态度，但在中短期情况下，全球经济持续疲软，美国加息周期虽然延迟，但终究会到来，全球通胀低于预期将压制黄金价格。我们将持续关注美国加息进程与全球地缘政治的冲突与发展，维持相对合理的黄金仓位，同时考虑到经济情况与工业需求的疲软，我们仍将主要配置黄金，少量或者不配置工业需求较大的白银和铂金。

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。报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、基金营运部和稽核监察部人员组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有丰富

的证券投资基金行业从业经验，能够胜任估值决策工作，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理不介入基金日常估值业务，但可以参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 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，本基金托管人在对汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)的管理人——汇添富基金管理有限公司在黄金及贵金属证券投资基金(LOF)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，黄金及贵金属证券投资基金(LOF)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黄金及贵金属证券投资基金(LOF) 2016年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)

报告截止日：2016年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：		
银行存款	17,781,978.14	26,558,801.67
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	191,391,044.03	170,168,805.07
其中：股票投资	-	-
基金投资	191,391,044.03	170,168,805.07
债券投资	-	-
资产支持证 券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	4,259,604.30	-
应收利息	1,688.63	2,386.09
应收股利	-	-
应收申购款	2,400,887.93	161,151.71

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	215,835,203.03	196,891,144.54
负债和所有者权益	本期末 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	9,505,136.87
应付赎回款	7,789,455.27	202,549.51
应付管理人报酬	166,324.86	163,045.58
应付托管费	43,244.47	42,391.85
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	342,382.24	370,593.17
负债合计	8,341,406.84	10,283,716.98
所有者权益：		
实收基金	321,611,425.24	360,668,206.28
未分配利润	-114,117,629.05	-174,060,778.72
所有者权益合计	207,493,796.19	186,607,427.56
负债和所有者权益总计	215,835,203.03	196,891,144.54

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值0.645元，基金份额总额321,611,425.24份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)

本报告期：2016年01月01日至2016年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年06 月30日	上年度可比期间 2015年01月01日至2015年06月 30日
一、收入	44,676,536.17	-10,689,408.76
1.利息收入	37,704.31	58,134.75
其中:存款利息收入	36,725.61	58,134.75
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	978.70	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-3,652,139.45	-27,067,635.89
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-3,652,139.45	-36,250,635.89
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	9,183,000.00
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	47,947,706.16	19,260,995.87
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	166,692.63	-3,248,806.49
5.其他收入(损失以“-”号填列)	176,572.52	307,903.00
减:二、费用	1,532,843.81	2,656,348.02
1.管理人报酬	1,001,031.67	1,343,521.51
2.托管费	260,268.24	349,315.58
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	57,429.20	750,178.45
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	214,114.70	213,332.48
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	43,143,692.36	-13,345,756.78

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)

本报告期：2016年01月01日 至 2016年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日 至 2016年06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）	360,668, 206.28	- 174,060, 778.72	186,607, 427.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（ 本期净利润）	-	43,143,6 92.36	43,143,6 92.36
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）	- 39,056,7 81.04	16,799,4 57.31	- 22,257,3 23.73
其中：1. 基金申购款	189,469, 694.10	- 76,302,0 80.71	113,167, 613.39
2. 基金赎回款	- 228,526, 475.14	93,101,5 38.02	- 135,424, 937.12
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）	321,611, 425.24	- 114,117, 629.05	207,493, 796.19
项目	上年度可比期间 2015年01月01日 至 2015年06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）	266,423,521.68	- 105,894,757.36	160,528,764.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	- 13,345,756.78	- 13,345,756.78
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）	139,528,377.28	- 41,612,852.99	97,915,524.29
其中：1. 基金申购款	560,229,167.68	- 196,537,539.91	363,691,627.77
2. 基金赎回款	- 420,700,790.40	- 154,924,686.92	- 265,776,103.48
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）	405,951,898.96	- 160,853,367.13	245,098,531.83

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

<u>张晖</u>	<u>张晖</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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)（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]838号文《关于核准汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）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8月31日正式生效，首次设立募集规模为614,808,767.15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。本基金的投资范围主要包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金中有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF)、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金综合考虑国际政治、经济、汇市、战争、主要国家货币和利率政策、贵金属市场供求等多方面因素，重点投资于境外上市有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF)，长期持有结合动态调整。本基金的业绩比较基准为：伦敦金价格折成人民币后的收益率(伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix)，人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则——基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修改的《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2016年6月30日的财务状况以及2016年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 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。

6.4.5 税项

经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：（1）以发行基金方式募集资金，不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税；（2）基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；（3）基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1

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。

6.4.6.2 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
布朗兄弟哈里曼银行 (Brown Brothers Hariman & Co.)	基金境外托管人
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
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

注： 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。 经本公司2016年第二次股东大会审议通过， 并经中国证券监督管理委员会批复核准， 本公司的股东文汇新民联合报业集团已变更为上海上报资产管理有限公司。 本公司已于2016年8月13日就上述股东变更事项进行公告。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期以及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.7.1 关联方报酬

6.4.7.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日至 2016年06月30日	2015年01月01日至 2015年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,001,031.67	1,343,521.51
其中：支付销售机构的客户维护费	231,021.41	247,343.35

注： 本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%的年费率计提。 计算方法如下： $H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$ 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 基金的管理费每日计算，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5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.7.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日 至 2016年06月30日	2015年01月01日 至 2015年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	260,268.24	349,315.58

注： 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.26%的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.26\% \div \text{当年天数}$ 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 基金的托管费每日计算，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5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。

6.4.7.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本期未有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.7.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.3.1 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区间未运用固有资金投资本基金。

6.4.7.3.2

报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未投资本基金。

6.4.7.4 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	
	2016年01月01日至2016年06月30日		2015年01月01日至2015年06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	7,302,614.54	36,725.61	7,620,852.76	57,787.71
布朗兄弟哈里曼银行	10,479,363.60	-	1,205.05	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按适用利率计息。

6.4.7.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.8 期末本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9 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	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	191,391,044.03	88.67
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,781,978.14	8.24
8	其他各项资产	6,662,180.86	3.09
9	合计	215,835,203.03	100.00

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
香港	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有股票以及存托凭证。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票以及其他权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票以及其他权益投资。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票以及其他权益投资。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票以及其他权益投资。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票以及其他权益投资。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	JB PHYSICAL GOLD FUND	ETF 基金	契约型开放式	Swiss & Global Asset Management	33,874,556.83	16.33
2	ISHARES GOLD TRUST	ETF 基金	契约型开放式	Black Rock Fund Advisors	33,845,644.80	16.31
3	UBS IS-GOLD CHEF HEDGE	ETF 基金	契约型开放式	UBS Fund Management(Switzerland) AG	33,576,109.91	16.18
4	SPDR GOLD SHARES	ETF 基金	契约型开放式	State Street Bank and Trust Company	31,042,238.69	14.96
5	ETFS GOLD TRUST	ETF 基金	契约型开放式	ETFs Securities US (LLC)	29,928,263.40	14.42
6	SPROTT PHYSICAL GOLD	ETF 基金	契约型开放式	Sprott Asset Management LP	29,124,230.40	14.04

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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

7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	4,259,604.30
3	应收股利	-
4	应收利息	1,688.63
5	应收申购款	2,400,887.93
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,662,180.86

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数(户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例(%)	持有份额	占总份额比 例(%)
10,929	29,427.34	6,754,73 6.10	2.10	314,856,68 9.14	97.90

8.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富黄金及贵金属(QDII-LOF-FOF)

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比 例(%)
1	东证资管-工行-东方红-量化1号集 合资产管理计划	3,100,000.00	4.73
2	李欣	2,500,000.00	3.81
3	陶昉敏	2,348,682.00	3.58
4	唐苏芳	2,192,500.00	3.34
5	吴至斌	1,778,800.00	2.71
6	中信信托有限责任公司-企业年金资 金信托12	1,500,045.00	2.29

7	肖贵华	1,451,200.00	2.21
8	黄松友	1,449,800.00	2.21
9	彭兴文	1,300,000.00	1.98
10	廖桂香	1,054,400.00	1.61

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	68,221.77	0.02

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011-08-31）基金份额总额	614,808,767.15
本报告期期初基金份额总额	360,668,206.28
本报告期基金总申购份额	189,469,694.10
减：本报告期基金总赎回份额	228,526,475.14
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	321,611,425.24

注：总申购份额含红利再投份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、基金管理人2016年1月14日公告，陈晓翔先生不再担任汇添富价值精选混合型证券投资基金的基金经理，由劳杰男先生单独管理该基金。
- 2、《汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于2016年1月21日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。
- 3、《汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年3月11日正式生效，何旻先生和李怀定先生任该基金的基金经理。
- 4、基金管理人2016年3月12日公告，增聘马翔先生担任汇添富民营活力混合型证券投资基金的基金经理，同时，朱晓亮先生不再担任该基金的基金经理。
- 5、《汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2016年3月16日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。
- 6、基金管理人2016年4月2日公告，陈灿辉先生不再担任副总经理。
- 7、基金管理人2016年4月9日公告，增聘胡昕炜先生担任汇添富消费行业混合型证券投资基金的基金经理，同时，朱晓亮先生不再担任该基金的基金经理。
- 8、《汇添富盈安保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年4月19日正式生效，曾刚先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。
- 9、《汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2016年6月3日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。
- 10、基金管理人2016年6月8日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。
- 11、基金管理人2016年6月8日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。
- 12、基金管理人2016年6月8日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。
- 13、基金管理人2016年6月8日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富理财30天债券型证券投资基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。
- 14、基金管理人2016年6月8日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富添富通货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

15、基金管理人2016年6月8日公告，增聘蒋文玲女士担任汇添富货币市场基金的基金经理，同时，汤从珊女士不再担任该基金的基金经理。

16、本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，针对中国证监会出具的责令改正措施，以及对相关负责人的警示，公司高度重视，逐一落实各项整改要求，针对性的制定、实施整改措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理的能力。目前公司已完成相关整改工作。

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	
Morga	1	-	-%	8,6	100.0	

n Stanley				79.41	0%
招商 国际	1	-	-%	-	-%
CS	1	-	-%	-	-%
建银 国际	1	-	-%	-	-%
UBS	1	-	-%	-	-%
德意 志银行	1	-	-%	-	-%
KGI	1	-	-%	-	-%
麦格 里	1	-	-%	-	-%
工银 国际	1	-	-%	-	-%
海通 大福	1	-	-%	-	-%
中金 香港	1	-	-%	-	-%
平安 香港	1	-	-%	-	-%
里昂	1	-	-%	-	-%
JP Mo rgan	1	-	-%	-	-%
GS	1	-	-%	-	-%
Merri ll Lynch	1	-	-%	-	-%

a	Nomur	1	-	-%	-	-%
t	Knigh	1	-	-%	-	-%
	东方 香港	1	-	-%	-	-%
	中信 国际	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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Morgan Stanley	-	-%	-	-%	-	-%	8,284,784.50	100.00%
招商国际	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
CS	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
建银国际	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
UBS	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
德意志银行	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
KGI	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
麦格里	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
工银国际	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
海通大福	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%

中金香港	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
平安香港	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
里昂	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
JP Morgan	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
GS	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
Merrill Lynch	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
Nomura	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
Knight	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
东方香港	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
中信国际	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%

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:本基金本报告期内未新增和减少交易单元。

汇添富基金管理股份有限公司

2016年8月27日