

汇添富上证综合指数证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 26 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 2017 年 8 月 24 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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
§5 托管人报告	17
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真实、准确和完整发表意见	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
7.7 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.....	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	64

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富上证综合指数证券投资基金
基金简称	汇添富上证综合指数
基金主代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 7 月 1 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	1,343,999,940.92 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 6%，以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。
业绩比较基准	上证综合指数收益率×95% + 银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。

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	郭明
	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	易会满

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	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层

§ 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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,641,900.21
本期利润	81,364,497.28
加权平均基金份额本期利润	0.0580
本期加权平均净值利润率	5.73%
本期基金份额净值增长率	5.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	52,228,383.73
期末可供分配基金份额利润	0.0389
期末基金资产净值	1,396,228,324.65
期末基金份额净值	1.039
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	14.65%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.38%	0.46%	2.29%	0.48%	1.09%	-0.02%
过去三个月	1.66%	0.52%	-0.88%	0.55%	2.54%	-0.03%
过去六个月	5.91%	0.49%	2.73%	0.52%	3.18%	-0.03%
过去一年	13.93%	0.59%	8.54%	0.61%	5.39%	-0.02%
过去三年	63.32%	1.70%	53.11%	1.65%	10.21%	0.05%
自基金合同生效日起至今	14.65%	1.43%	7.63%	1.40%	7.02%	0.03%

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

汇添富上证综合指数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：本基金建仓期为自《基金合同》生效之日（2009 年 7 月 1 日）起 3 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立，注册资本为 132,724,224 元人民币。截止到 2017 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 2898.83 亿元，有效客户数约 1500 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 85 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、汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）、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、汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金、汇添富盈稳保本混合型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫保本混合型证券投资基金、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金、汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）、汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金、汇添富鑫利债券型证券投资基金、汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、汇添富中国高端制造股票型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富精选美元债债券型证券投资基金、汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金。

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	2010 年 2 月 5 日	-	11 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

	消费 ETF 联接基金、汇添富中证精准医指数基金、中证上海国企 ETF、汇添富中证互联网医疗指数 (LOF) 的基金经理，指数与量化投资部副总监。				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 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费 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，2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理，2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理，2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗指数 (LOF) 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 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，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、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 8 次，由于组合投资策略导致，并经过公司内部风控审核。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内经济数据一季度回暖，二季度整体保持平稳，出口转暖，企业盈利整体改善，经济保持韧性。政策面上，供给侧改革持续推进，结构性减税降费措施密集推出，混改加速，PPP持续落地，雄安、粤港澳大湾区、长江经济带等地区经济规划陆续出台，为市场提供了持续的政策热点。此外，全球股市表现良好，人民币汇率稳定，美国新总统执政后，政策不确定性低于预期，为 A 股创造了良好的外部环境。

另一方面，市场结构发生了较大变化。在经济脱虚向实的大背景下，金融、地产领域的监管加强，金融去杠杆的政策主线开始明确；IPO 加速，“壳价值”大幅下降；外延式并购得到控制。市场流动性较为紧张，成交活跃度下降，一些估值过高的行业和中小盘股票价格出现了一定程度的回调。投资者的关注点回归到企业的盈利能力和业绩的稳定性上，一些业绩确定性强、中长期配置价值突出的白马风格的行业和个股受到了市场追捧。在经济平稳、外延并购得到有效控制，供给出清、行业集中度提升背景下，市场预期社会资源可能在未来加速向各行业的龙头公司聚集；同时，纳入 MSCI 引起的境外流入资金也更偏向大盘价值风格，导致上半年大小盘分化明显。同时，供给侧改革持续推进，部分周期行业产能去化充分，盈利得到了较大的提升。具有高盈利、成长稳定、低估值、大市值特性的股票表现出色。

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 92%~95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。本基金对抽样复制组合继续采取缓冲式调整，降低了冗余的交易量。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内上综指基准上涨 2.73%，本基金在报告期内累计收益率为 5.91%，收益率超越业绩比较基准 3.18%。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 0.1134%，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

下半年经济基本面大概率仍将保持稳中向好的态势。促转型和防风险仍是政策主基调。促转型方面，“放管服”改革优化政府服务，减税降费降低企业负担，租售并举降低个人房租成本，这些措施长期看都有利于经济活力的激发；防风险方面，金融去杠杆、地方政府债务和房地产风险防控可能仍是政策的着力点，虽然可能带来短期的流动性压力，但长期看风险的化解有利于风险

偏好的提升。十九大召开将明确未来长期的发展和改革目标，改革路径的明确和逐步落地将给中国经济带来新的活力。此外，一带一路、京津冀、雄安新区、混改、环保等主题在下半年仍可能持续发酵，带来事件性投资机会。国外，美欧步入经济复苏、金融加杠杆的扩张周期，利好中国出口，给中国经济带来良好的外部环境。

股票市场，当前平稳的宏观环境仍较难支撑市场的全面上涨，防风险、去杠杆可能给市场流动性带来压力；但受益于供给侧改革的行业的盈利复苏和改革落地带来的风险偏好改善很可能市场带来正面影响。风格方面，导致大小盘分化的宏观及监管因素在下半年大概率仍将存在，但目前大小盘估值已经大幅收敛，下半年风格差异相比上半年可能减少。行业方面，着眼于长期，增长较为稳定、受益消费升级的消费类行业；受益于出口复苏，代表经济转型和结构升级方向的高科技制造业；与生态文明建设相关的环保行业可能存在投资机会。

上证指数作为蓝筹标的，在当前市场环境下估值更具安全性，可能收益于供给侧改革和国企改革推进，从而带来一定的投资机会。

作为被动投资的指数型基金，汇添富上证综合指数基金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。

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。

4.7 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：每在符合上述基金收益分配的前提下，每年度 6 月和 12 月的最后一个交易日每份基金份额可供分配利润超过 0.02 元时，至少将期末可供分配利润的 20%进行收益分配，且在收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）之后的 15 个工作日之内完成。

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合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富上证综合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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，汇添富上证综合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汇添富上证综合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，汇添富上证综合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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富上证综合指数证券投资基金 2017 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：汇添富上证综合指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	77,403,379.56	90,388,570.40
结算备付金		-	-
存出保证金		17,105.35	18,728.24
交易性金融资产	6.4.7.2	1,321,800,984.12	1,313,598,268.07
其中：股票投资		1,321,800,984.12	1,313,598,268.07
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	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	14,814.92	18,153.15
应收股利		-	-
应收申购款		140,373.68	1,444,020.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,399,376,657.63	1,405,467,740.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			
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		-	-
应付赎回款		1,804,240.23	863,667.50
应付管理人报酬		850,292.66	905,712.17
应付托管费		170,058.53	181,142.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	31,229.74	38,825.65

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	292,511.82	401,310.92
负债合计		3,148,332.98	2,390,658.68
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,343,999,940.92	1,429,614,792.90
未分配利润	6.4.7.10	52,228,383.73	-26,537,711.35
所有者权益合计		1,396,228,324.65	1,403,077,081.55
负债和所有者权益总计		1,399,376,657.63	1,405,467,740.23

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 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.039 元，基金份额总额 1,343,999,940.92 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		88,038,125.46	-253,240,429.98
1.利息收入		327,508.64	339,843.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	327,326.83	338,773.17
债券利息收入		181.81	1,070.28
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）		11,844,292.57	12,126,310.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	29,214.08	-1,687,583.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	50,913.69	367,661.92
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	11,764,164.80	13,446,231.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	75,722,597.07	-265,900,400.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	143,727.18	193,816.99
减：二、费用		6,673,628.18	6,539,681.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,282,686.67	5,091,912.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,056,537.38	1,018,382.55
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	136,834.84	224,326.22
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	197,569.29	205,059.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		81,364,497.28	-259,780,111.72

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	1,429,614,792.90	-26,537,711.35	1,403,077,081.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	81,364,497.28	81,364,497.28
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）	-85,614,851.98	-2,598,402.20	-88,213,254.18
其中：1.基金申购款	147,486,172.62	1,600,026.41	149,086,199.03
2. 基金赎回款	-233,101,024.60	-4,198,428.61	-237,299,453.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,343,999,940.92	52,228,383.73	1,396,228,324.65

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	1,414,386,675.29	193,489,709.77	1,607,876,385.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-259,780,111.72	-259,780,111.72
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）	91,039,652.94	-7,764,754.84	83,274,898.10
其中：1.基金申购款	297,775,221.03	-25,036,208.61	272,739,012.42
2.基金赎回款	-206,735,568.09	17,271,453.77	-189,464,114.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-58,501,819.09	-58,501,819.09
五、期末所有者权益（基金净值）	1,505,426,328.23	-132,556,975.88	1,372,869,352.35

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖	李骁	雷青松
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

汇添富上证综合指数证券投资基金（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[2009]371 号文《关于核准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理有限公司（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 2009 年 7 月 1 日正式生效，首次设立募集规模为 9,097,758,651.47 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与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括上海证券交易所上市交易的所有股票、新股（如一级市场初次发行或增发）等。如以后法律法规及中国证监会允许基金投资其他金融工具，

如股指期货、ETF 等，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定，将其纳入投资范围。本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。本基金的业绩比较基准为：上证综合指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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〉》、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。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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

6.4.6.1 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[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。

6.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

6.4.6.4 个人所得税

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》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[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[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。

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	77,403,379.56
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	77,403,379.56

注：本基金本期末未投资于定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,214,906,913.41	1,321,800,984.12	106,894,070.71
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,214,906,913.41	1,321,800,984.12	106,894,070.71

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	14,807.99
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	-
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	6.93
合计	14,814.92

注：“其他”为结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	31,229.74
银行间市场应付交易费用	-
合计	31,229.74

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,074.53
应付信息披露费	248,765.71
应付审计费用	39,671.58
合计	292,511.82

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,429,614,792.90	1,429,614,792.90
本期申购	147,486,172.62	147,486,172.62
本期赎回(以“-”号填列)	-233,101,024.60	-233,101,024.60
- 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	1,343,999,940.92	1,343,999,940.92

注：本期申购中包含红利再投、转换入份额，本期赎回中包含转换出份额。

6.4.7.10 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	372,810,946.52	-399,348,657.87	-26,537,711.35
本期利润	5,641,900.21	75,722,597.07	81,364,497.28
本期基金份额交易产生的变动数	-22,233,513.19	19,635,110.99	-2,598,402.20
其中：基金申购款	38,399,555.42	-36,799,529.01	1,600,026.41
基金赎回款	-60,633,068.61	56,434,640.00	-4,198,428.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	356,219,333.54	-303,990,949.81	52,228,383.73

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	325,682.43
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	-
其他	1,644.40

合计	327,326.83
----	------------

注：表中“其他”指直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	71,678,190.23
减：卖出股票成本总额	71,648,976.15
买卖股票差价收入	29,214.08

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,710,095.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,659,000.00
减：应收利息总额	181.81
买卖债券差价收入	50,913.69

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本期末未持有贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本期未投资衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	11,764,164.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,764,164.80

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	75,722,597.07
——股票投资	75,722,597.07
——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	75,722,597.07

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	143,727.18
其他收入	-
合计	143,727.18

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	136,834.84
银行间市场交易费用	-
合计	136,834.84

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
银行划款费用	132.00
帐户维护费	9,000.00
合计	197,569.29

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

本基金于资产负债表日之后、年度报告批准报出日之前批准、公告和实施的利润分配的情况如下：本基金于 2017 年 7 月 19 日（权益登记日），2017 年 7 月 19 日（场外除息日），每 10 份基金份额派发红利 0.08 元，共分配收益 10,525,960.72 元，其中，现金红利发放金额为 5,696,623.93 元，红利在投资金额为 4,829,336.79。截至财务报表批准日，除上述利润分配事项及在 6.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

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。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
东方证券股份有限公司	67,734,970.18	100.00%	157,369,647.43	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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司	1,710,095.50	100.00%	2,433,732.20	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本期末未通过关联方交易单元进行权证交易

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
东方证券股 份有限公司	63,082.12	100.00%	31,229.74	100.00%

关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东方证券股份有限公司	146,559.29	100.00%	37,801.90	100.00%

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 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,282,686.67	5,091,912.99
其中：支付销售机构的客户维护费	1,077,078.01	1,053,117.74

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

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 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,056,537.38	1,018,382.55

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金与关联方本期和上年度可比期间未通过银行间同业市场进行债券（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：本报告期内及上年度可比期间基金管理人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

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均未投资本基金。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	77,403,379.56	325,682.43	99,864,703.13	333,813.42

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

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 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：本基金在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
601088	中国神华	2017 年 6 月 5 日	重大事项停牌	22.29	-	-	833,330	20,189,236.39	18,574,925.70	-
600050	中国联通	2017 年 4 月 5 日	重大事项停牌	6.85	2017 年 8 月 21 日	8.22	1,076,938	6,339,569.19	7,377,025.30	-
601989	中国重工	2017 年 5 月 31 日	重大资产重组停牌	6.21	-	-	853,429	6,201,144.62	5,299,794.09	-
601727	上海电气	2017 年 6 月 22 日	重大事项停牌	7.57	2017 年 7 月 3 日	7.54	570,492	5,499,739.32	4,318,624.44	-
600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	重大资产重组停牌	7.29	-	-	483,352	2,455,569.02	3,523,636.08	-
600795	国电电力	2017 年 6 月 5 日	重大资产重组停牌	3.60	-	-	828,428	3,115,773.19	2,982,340.80	-
601919	中远海控	2017 年 5 月 17 日	重大资产重组停牌	5.35	2017 年 7 月 26 日	5.89	429,538	2,176,176.39	2,298,028.30	-
601608	中信重工	2017 年 4 月 19 日	重大事项停牌	5.54	2017 年 7 月 26 日	5.26	336,785	1,008,977.19	1,865,788.90	-

600559	老白干酒	2017年1月23日	重大资产重组停牌	22.69	-	-	81,606	1,170,399.10	1,851,640.14	-
600602	云赛智联	2017年6月22日	重大事项停牌	7.51	2017年7月4日	7.80	215,021	1,412,707.21	1,614,807.71	-
600643	爱建集团	2017年4月17日	重大资产重组停牌	14.98	2017年8月2日	16.48	106,902	973,837.81	1,601,391.96	-
601872	招商轮船	2017年5月2日	重大事项停牌	5.16	-	-	284,008	1,467,649.63	1,465,481.28	-
600460	士兰微	2017年5月12日	重大事项停牌	6.07	2017年8月15日	6.68	230,532	1,718,612.96	1,399,329.24	-
600100	同方股份	2017年4月21日	重大资产重组停牌	14.12	-	-	91,222	1,031,407.93	1,288,054.64	-
600485	信威集团	2017年12月26日	重大资产重组停牌	14.59	-	-	87,151	3,187,718.99	1,271,533.09	-
600172	黄河旋风	2017年6月30日	重大事项停牌	8.23	2017年7月14日	8.00	114,432	512,389.71	941,775.36	-
600636	*ST爱富	2016年5月9日	重大资产重组停牌	13.86	2017年8月4日	14.55	65,739	929,151.63	911,142.54	-
600239	云南城投	2017年6月26日	重大事项停牌	5.22	-	-	162,550	919,055.03	848,511.00	-
600655	豫园商城	2017年12月20日	重大资产重组停牌	11.32	-	-	74,841	846,187.01	847,200.12	-

600657	信达地产	2017年2月20日	重大资产重组停牌	5.76	2017年8月10日	6.19	126,511	1,048,621.21	728,703.36	-
601717	郑煤机	2017年4月24日	重大资产重组停牌	7.55	-	-	93,087	1,062,551.66	702,806.85	-
600468	百利电气	2017年5月16日	重大资产重组停牌	6.50	-	-	107,150	1,050,002.82	696,475.00	-
601001	大同煤业	2017年6月22日	重大事项停牌	5.25	2017年7月21日	5.78	86,631	1,115,362.36	454,812.75	-

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

本基金本期末未持有在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

本基金本期末未持有在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。

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、存出保证金、部分交易性金融资产及部分应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	77,403,379.56	-	-	-	-	-	77,403,379.56
存出保证金	17,105.35	-	-	-	-	-	17,105.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,321,800,984.12	1,321,800,984.12
应收利息	-	-	-	-	-	14,814.92	14,814.92
应收申购款	49,309.90	-	-	-	-	91,063.78	140,373.68
资产总计	77,469,794.81	-	-	-	-	1,321,906,862.82	1,399,376,657.63
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	1,804,240.23	1,804,240.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	850,292.66	850,292.66
应付托管费	-	-	-	-	-	170,058.53	170,058.53
应付交易费用	-	-	-	-	-	31,229.74	31,229.74
其他负债	-	-	-	-	-	292,511.82	292,511.82
负债总计	-	-	-	-	-	3,148,332.98	3,148,332.98
利率敏感度缺口	77,469,794.81	-	-	-	-	-1,318,758,529.84	1,396,228,324.65
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	90,388,570.40	-	-	-	-	-	90,388,570.40
存出保证金	18,728.24	-	-	-	-	-	18,728.24
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,313,598,268.07	1,313,598,268.07
应收利息	-	-	-	-	-	18,153.15	18,153.15
应收申购款	74,785.16	-	-	-	-	1,369,235.21	1,444,020.37
资产总计	90,482,083.80	-	-	-	-	-1,314,985,656.43	1,405,467,740.23
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	863,667.50	863,667.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	905,712.17	905,712.17
应付托管费	-	-	-	-	-	181,142.44	181,142.44
应付交易费用	-	-	-	-	-	38,825.65	38,825.65
其他负债	-	-	-	-	-	401,310.92	401,310.92
负债总计	-	-	-	-	-	2,390,658.68	2,390,658.68
利率敏感度缺口	90,482,083.80	-	-	-	-	-1,312,594,997.75	1,403,077,081.55

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。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。

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及应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,321,800,984.12	94.67	1,313,598,268.07	93.62
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	1,321,800,984.12	94.67	1,313,598,268.07	93.62

注：本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 90%-95%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；投资于标的指数成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%。

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，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	上证综合指数上涨 5%	62,595,646.72	65,423,894.40
	上证综合指数下跌 5%	-62,595,646.72	-65,423,894.40

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	1,321,800,984.12	94.46
	其中：股票	1,321,800,984.12	94.46
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	77,403,379.56	5.53
7	其他各项资产	172,293.95	0.01
8	合计	1,399,376,657.63	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境内股票投资组合

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	3,935,336.86	0.28
B	采矿业	144,511,028.79	10.35
C	制造业	424,890,946.55	30.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	64,332,679.89	4.61
E	建筑业	59,465,385.28	4.26
F	批发和零售业	43,598,094.55	3.12
G	交通运输、仓储和邮政业	68,565,046.62	4.91
H	住宿和餐饮业	5,426,696.80	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,538,932.49	2.12
J	金融业	401,306,699.54	28.74
K	房地产业	52,606,843.18	3.77
L	租赁和商务服务业	7,262,564.10	0.52
M	科学研究和技术服务业	—	—

N	水利、环境和公共设施管理业	3,276,075.90	0.23
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	8,355,064.86	0.60
S	综合	4,729,588.71	0.34
	合计	1,321,800,984.12	94.67

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未进行积极投资。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未有沪港通股票投资。

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

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	601857	中国石油	8,121,557	62,454,773.33	4.47
2	601288	农业银行	14,818,193	52,160,039.36	3.74
3	601988	中国银行	13,797,511	51,050,790.70	3.66
4	600036	招商银行	2,109,932	50,448,474.12	3.61
5	600519	贵州茅台	69,157	32,631,730.45	2.34
6	601166	兴业银行	1,695,335	28,583,348.10	2.05
7	601628	中国人寿	1,048,954	28,300,778.92	2.03
8	600028	中国石化	4,753,651	28,189,150.43	2.02
9	601328	交通银行	4,341,517	26,743,744.72	1.92
10	601318	中国平安	478,798	23,753,168.78	1.70
11	601939	建设银行	3,581,811	22,028,137.65	1.58
12	601766	中国中车	1,946,361	19,697,173.32	1.41
13	601088	中国神华	833,330	18,574,925.70	1.33
14	600104	上汽集团	566,704	17,596,159.20	1.26
15	600900	长江电力	999,996	15,379,938.48	1.10
16	601668	中国建筑	1,421,546	13,760,565.28	0.99
17	600000	浦发银行	1,001,740	12,672,011.00	0.91
18	600887	伊利股份	564,542	12,188,461.78	0.87
19	601601	中国太保	318,796	10,797,620.52	0.77
20	601998	中信银行	1,604,072	10,089,612.88	0.72

21	601800	中国交建	566,044	8,994,439.16	0.64
22	601818	光大银行	2,103,667	8,519,851.35	0.61
23	600030	中信证券	494,700	8,419,794.00	0.60
24	600018	上港集团	1,225,255	7,768,116.70	0.56
25	601336	新华保险	150,062	7,713,186.80	0.55
26	600016	民生银行	922,714	7,584,709.08	0.54
27	600019	宝钢股份	1,103,478	7,404,337.38	0.53
28	600276	恒瑞医药	146,269	7,399,748.71	0.53
29	601169	北京银行	805,860	7,389,736.20	0.53
30	600050	中国联通	1,076,938	7,377,025.30	0.53
31	601390	中国中铁	847,773	7,350,191.91	0.53
32	600978	宜华生活	708,484	7,120,264.20	0.51
33	601006	大秦铁路	798,244	6,697,267.16	0.48
34	600066	宇通客车	299,103	6,571,292.91	0.47
35	601186	中国铁建	540,659	6,504,127.77	0.47
36	600674	川投能源	625,200	6,139,464.00	0.44
37	603288	海天味业	148,677	6,063,048.06	0.43
38	600079	人福医药	304,494	5,974,172.28	0.43
39	600837	海通证券	398,593	5,919,106.05	0.42
40	600015	华夏银行	622,298	5,737,587.56	0.41
41	600999	招商证券	329,394	5,672,164.68	0.41
42	601688	华泰证券	297,013	5,316,532.70	0.38
43	601989	中国重工	853,429	5,299,794.09	0.38
44	601238	广汽集团	197,854	5,156,075.24	0.37
45	600893	航发动力	188,352	5,142,009.60	0.37
46	600048	保利地产	512,368	5,108,308.96	0.37
47	601111	中国国航	513,621	5,007,804.75	0.36
48	600585	海螺水泥	220,084	5,002,509.32	0.36
49	600518	康美药业	221,460	4,814,540.40	0.34
50	600021	上海电力	396,566	4,794,482.94	0.34
51	600525	长园集团	351,858	4,781,750.22	0.34
52	600755	厦门国贸	494,523	4,510,049.76	0.32
53	600522	中天科技	372,073	4,483,479.65	0.32
54	601618	中国中冶	868,449	4,350,929.49	0.31
55	601633	长城汽车	326,735	4,342,308.15	0.31
56	601727	上海电气	570,492	4,318,624.44	0.31
57	600703	三安光电	218,436	4,303,189.20	0.31
58	601888	中国国旅	140,684	4,240,215.76	0.30
59	600236	桂冠电力	730,998	4,166,688.60	0.30

60	600690	青岛海尔	275,700	4,149,285.00	0.30
61	600498	烽火通信	163,215	4,137,500.25	0.30
62	600340	华夏幸福	123,020	4,131,011.60	0.30
63	600804	鹏博士	226,750	4,024,812.50	0.29
64	601018	宁波港	709,374	4,007,963.10	0.29
65	600884	杉杉股份	242,293	3,990,565.71	0.29
66	600161	天坛生物	101,856	3,953,031.36	0.28
67	600435	北方导航	275,896	3,948,071.76	0.28
68	600352	浙江龙盛	412,722	3,933,240.66	0.28
69	600110	诺德股份	270,070	3,805,286.30	0.27
70	600685	中船防务	136,287	3,731,538.06	0.27
71	600309	万华化学	129,511	3,709,195.04	0.27
72	601669	中国电建	463,883	3,673,953.36	0.26
73	600820	隧道股份	361,790	3,654,079.00	0.26
74	600004	白云机场	197,845	3,652,218.70	0.26
75	600426	华鲁恒升	310,229	3,642,088.46	0.26
76	600649	城投控股	346,525	3,641,977.75	0.26
77	601225	陕西煤业	510,203	3,607,135.21	0.26
78	600673	东阳光科	483,352	3,523,636.08	0.25
79	600705	中航资本	618,756	3,495,971.40	0.25
80	600765	中航重机	250,249	3,448,431.22	0.25
81	600011	华能国际	466,862	3,426,767.08	0.25
82	600688	上海石化	513,794	3,396,178.34	0.24
83	600754	锦江股份	123,672	3,351,511.20	0.24
84	600009	上海机场	89,038	3,322,007.78	0.24
85	601216	君正集团	676,250	3,306,862.50	0.24
86	601009	南京银行	291,454	3,267,199.34	0.23
87	600516	方大炭素	226,803	3,225,138.66	0.23
88	600511	国药股份	88,222	3,197,165.28	0.23
89	600029	南方航空	362,748	3,155,907.60	0.23
90	600886	国投电力	398,518	3,148,292.20	0.23
91	600037	歌华有线	215,838	3,142,601.28	0.23
92	600741	华域汽车	128,369	3,111,664.56	0.22
93	601899	紫金矿业	900,342	3,088,173.06	0.22
94	600570	恒生电子	66,155	3,088,115.40	0.22
95	601788	光大证券	206,238	3,079,133.34	0.22
96	600196	复星医药	99,297	3,077,214.03	0.22
97	600303	曙光股份	300,554	3,071,661.88	0.22
98	600867	通化东宝	167,034	3,046,700.16	0.22

99	601718	际华集团	340,296	2,991,201.84	0.21
100	600835	上海机电	141,463	2,990,527.82	0.21
101	600795	国电电力	828,428	2,982,340.80	0.21
102	600637	东方明珠	136,130	2,949,937.10	0.21
103	600158	中体产业	168,896	2,888,121.60	0.21
104	600023	浙能电力	528,492	2,885,566.32	0.21
105	600031	三一重工	353,224	2,871,711.12	0.21
106	601898	中煤能源	486,415	2,860,120.20	0.20
107	600827	百联股份	173,488	2,819,180.00	0.20
108	600547	山东黄金	96,319	2,786,508.67	0.20
109	600663	陆家嘴	115,443	2,729,072.52	0.20
110	601607	上海医药	94,397	2,726,185.36	0.20
111	600418	江淮汽车	257,644	2,718,144.20	0.19
112	601377	兴业证券	361,110	2,683,047.30	0.19
113	600115	东方航空	393,826	2,678,016.80	0.19
114	601992	金隅股份	413,462	2,675,099.14	0.19
115	600481	双良节能	493,768	2,621,908.08	0.19
116	600811	东方集团	401,041	2,614,787.32	0.19
117	600183	生益科技	209,794	2,588,857.96	0.19
118	601200	上海环境	96,720	2,581,456.80	0.18
119	600529	山东药玻	104,998	2,579,800.86	0.18
120	600660	福耀玻璃	98,930	2,576,137.20	0.18
121	603993	洛阳钼业	508,839	2,574,725.34	0.18
122	600312	平高电气	186,473	2,562,139.02	0.18
123	600007	中国国贸	122,057	2,540,006.17	0.18
124	600694	大商股份	65,022	2,533,907.34	0.18
125	600628	新世界	217,885	2,516,571.75	0.18
126	600153	建发股份	191,795	2,479,909.35	0.18
127	600020	中原高速	482,901	2,433,821.04	0.17
128	601933	永辉超市	343,401	2,431,279.08	0.17
129	600995	文山电力	249,808	2,430,631.84	0.17
130	600062	华润双鹤	88,359	2,423,687.37	0.17
131	600010	包钢股份	1,100,182	2,409,398.58	0.17
132	600006	东风汽车	411,339	2,406,333.15	0.17
133	600491	龙元建设	223,545	2,398,637.85	0.17
134	601877	正泰电器	118,853	2,387,756.77	0.17
135	600383	金地集团	207,931	2,384,968.57	0.17
136	600597	光明乳业	186,910	2,383,102.50	0.17
137	600535	天士力	56,850	2,361,549.00	0.17

138	600008	首创股份	357,300	2,351,034.00	0.17
139	600456	宝钛股份	113,502	2,329,061.04	0.17
140	600085	同仁堂	66,454	2,323,231.84	0.17
141	600839	四川长虹	639,693	2,315,688.66	0.17
142	600406	国电南瑞	130,602	2,305,125.30	0.17
143	601919	中远海控	429,538	2,298,028.30	0.16
144	600177	雅戈尔	226,922	2,296,450.64	0.16
145	600176	中国巨石	207,905	2,282,796.90	0.16
146	600068	葛洲坝	200,119	2,249,337.56	0.16
147	600143	金发科技	367,633	2,216,826.99	0.16
148	600667	太极实业	317,112	2,210,270.64	0.16
149	600436	片仔癀	36,133	2,205,558.32	0.16
150	600332	白云山	75,565	2,194,407.60	0.16
151	601991	大唐发电	484,741	2,191,029.32	0.16
152	600246	万通地产	442,342	2,189,592.90	0.16
153	600170	上海建工	572,151	2,185,616.82	0.16
154	600517	置信电气	281,514	2,131,060.98	0.15
155	600816	安信信托	156,176	2,122,431.84	0.15
156	600888	新疆众和	341,591	2,111,032.38	0.15
157	600829	人民同泰	170,543	2,104,500.62	0.15
158	600271	航天信息	101,224	2,089,263.36	0.15
159	600428	中远海特	335,655	2,087,774.10	0.15
160	601600	中国铝业	461,565	2,086,273.80	0.15
161	600258	首旅酒店	88,835	2,075,185.60	0.15
162	600415	小商品城	280,473	2,030,624.52	0.15
163	600226	瀚叶股份	229,832	2,029,416.56	0.15
164	600595	中孚实业	413,749	1,994,270.18	0.14
165	600089	特变电工	191,219	1,975,292.27	0.14
166	600782	新钢股份	537,280	1,961,072.00	0.14
167	600033	福建高速	506,767	1,930,782.27	0.14
168	600219	南山铝业	568,422	1,926,950.58	0.14
169	600998	九州通	89,283	1,924,941.48	0.14
170	600499	科达洁能	242,232	1,923,322.08	0.14
171	600873	梅花生物	336,531	1,908,130.77	0.14
172	600195	中牧股份	97,589	1,892,250.71	0.14
173	601231	环旭电子	119,778	1,881,712.38	0.13
174	600210	紫江企业	304,122	1,867,309.08	0.13
175	601608	中信重工	336,785	1,865,788.90	0.13
176	600859	王府井	114,710	1,852,566.50	0.13

177	600559	老白干酒	81,606	1,851,640.14	0.13
178	601880	大连港	625,245	1,850,725.20	0.13
179	600398	海澜之家	194,095	1,841,961.55	0.13
180	600619	海立股份	168,600	1,834,368.00	0.13
181	600188	兖州煤业	148,583	1,818,655.92	0.13
182	600720	祁连山	231,599	1,813,420.17	0.13
183	600863	内蒙华电	599,604	1,804,808.04	0.13
184	600308	华泰股份	314,515	1,786,445.20	0.13
185	601158	重庆水务	249,834	1,786,313.10	0.13
186	600051	宁波联合	185,492	1,773,303.52	0.13
187	600132	重庆啤酒	75,798	1,766,851.38	0.13
188	600549	厦门钨业	82,074	1,763,770.26	0.13
189	601808	中海油服	159,097	1,756,430.88	0.13
190	600377	宁沪高速	177,414	1,738,657.20	0.12
191	600151	航天机电	210,509	1,732,489.07	0.12
192	601555	东吴证券	152,397	1,711,418.31	0.12
193	600523	贵航股份	91,679	1,696,978.29	0.12
194	600300	维维股份	317,272	1,694,232.48	0.12
195	600809	山西汾酒	48,723	1,690,200.87	0.12
196	600648	外高桥	91,201	1,689,042.52	0.12
197	601599	鹿港文化	269,134	1,684,778.84	0.12
198	600369	西南证券	298,878	1,676,705.58	0.12
199	600971	恒源煤电	206,155	1,676,040.15	0.12
200	601117	中国化学	238,927	1,670,099.73	0.12
201	600221	海航控股	515,633	1,660,338.26	0.12
202	600489	中金黄金	164,543	1,650,366.29	0.12
203	600362	江西铜业	97,732	1,647,761.52	0.12
204	601098	中南传媒	88,361	1,647,049.04	0.12
205	600739	辽宁成大	90,748	1,636,186.44	0.12
206	600350	山东高速	263,897	1,636,161.40	0.12
207	600376	首开股份	142,641	1,631,813.04	0.12
208	601233	桐昆股份	117,030	1,622,035.80	0.12
209	601866	中远海发	448,833	1,615,798.80	0.12
210	600602	云赛智联	215,021	1,614,807.71	0.12
211	600118	中国卫星	57,805	1,609,291.20	0.12
212	600643	爱建集团	106,902	1,601,391.96	0.11
213	600621	华鑫股份	132,009	1,601,269.17	0.11
214	600510	黑牡丹	208,593	1,597,822.38	0.11
215	601003	柳钢股份	356,297	1,596,210.56	0.11

216	600162	香江控股	442,523	1,588,657.57	0.11
217	600109	国金证券	134,170	1,572,472.40	0.11
218	600266	北京城建	107,842	1,568,022.68	0.11
219	600993	马应龙	71,393	1,554,939.54	0.11
220	600825	新华传媒	218,079	1,546,180.11	0.11
221	600895	张江高科	91,192	1,539,320.96	0.11
222	600333	长春燃气	223,313	1,536,393.44	0.11
223	600208	新湖中宝	340,176	1,530,792.00	0.11
224	600409	三友化工	150,916	1,519,724.12	0.11
225	600372	中航电子	87,314	1,516,644.18	0.11
226	600331	宏达股份	277,558	1,515,466.68	0.11
227	600639	浦东金桥	83,540	1,513,744.80	0.11
228	600169	太原重工	391,491	1,511,155.26	0.11
229	600150	中国船舶	66,046	1,510,472.02	0.11
230	600880	博瑞传播	230,212	1,503,284.36	0.11
231	600497	驰宏锌锗	228,516	1,496,779.80	0.11
232	600683	京投发展	194,770	1,482,199.70	0.11
233	600586	金晶科技	300,617	1,470,017.13	0.11
234	600770	综艺股份	195,828	1,468,710.00	0.11
235	600298	安琪酵母	56,710	1,467,087.70	0.11
236	601872	招商轮船	284,008	1,465,481.28	0.10
237	601179	中国西电	262,735	1,460,806.60	0.10
238	600220	江苏阳光	425,382	1,459,060.26	0.10
239	600583	海油工程	226,820	1,415,356.80	0.10
240	600600	青岛啤酒	40,153	1,409,370.30	0.10
241	600460	士兰微	230,532	1,399,329.24	0.10
242	600588	用友网络	81,092	1,388,295.04	0.10
243	600017	日照港	307,570	1,384,065.00	0.10
244	601928	凤凰传媒	141,685	1,382,845.60	0.10
245	600190	锦州港	319,395	1,376,592.45	0.10
246	600642	申能股份	218,487	1,376,468.10	0.10
247	600584	长电科技	85,371	1,370,204.55	0.10
248	600743	华远地产	323,644	1,365,777.68	0.10
249	600664	哈药股份	234,056	1,359,865.36	0.10
250	601333	广深铁路	300,651	1,358,942.52	0.10
251	600578	京能电力	316,137	1,356,227.73	0.10
252	601777	力帆股份	168,456	1,354,386.24	0.10
253	600166	福田汽车	476,708	1,353,850.72	0.10
254	600027	华电国际	280,175	1,353,245.25	0.10

255	600108	亚盛集团	308,138	1,328,074.78	0.10
256	600160	巨化股份	109,953	1,322,734.59	0.09
257	600269	赣粤高速	252,321	1,314,592.41	0.09
258	600812	华北制药	218,635	1,309,623.65	0.09
259	600528	中铁工业	91,008	1,300,504.32	0.09
260	600611	大众交通	234,816	1,296,184.32	0.09
261	600100	同方股份	91,222	1,288,054.64	0.09
262	600569	安阳钢铁	454,848	1,287,219.84	0.09
263	600315	上海家化	39,599	1,284,987.55	0.09
264	600251	冠农股份	159,935	1,274,681.95	0.09
265	601107	四川成渝	269,834	1,273,616.48	0.09
266	600485	信威集团	87,151	1,271,533.09	0.09
267	601222	林洋能源	168,339	1,250,758.77	0.09
268	601699	潞安环能	156,642	1,224,940.44	0.09
269	600106	重庆路桥	235,388	1,216,955.96	0.09
270	601099	太平洋	297,645	1,196,532.90	0.09
271	600267	海正药业	102,388	1,195,891.84	0.09
272	600026	中远海能	180,298	1,195,375.74	0.09
273	600718	东软集团	76,092	1,183,230.60	0.08
274	600717	天津港	94,661	1,182,315.89	0.08
275	600831	广电网络	116,517	1,159,344.15	0.08
276	600970	中材国际	132,134	1,148,244.46	0.08
277	600808	马钢股份	318,630	1,127,950.20	0.08
278	601958	金钼股份	156,435	1,121,638.95	0.08
279	600098	广州发展	141,557	1,119,715.87	0.08
280	600724	宁波富达	233,993	1,109,126.82	0.08
281	601678	滨化股份	158,866	1,104,118.70	0.08
282	600256	广汇能源	260,589	1,078,838.46	0.08
283	601168	西部矿业	139,169	1,070,209.61	0.08
284	600117	西宁特钢	210,865	1,062,759.60	0.08
285	600067	冠城大通	154,132	1,058,886.84	0.08
286	600596	新安股份	123,621	1,044,597.45	0.07
287	601118	海南橡胶	182,587	1,037,094.16	0.07
288	600325	华发股份	121,762	1,016,712.70	0.07
289	601588	北辰实业	162,132	1,005,218.40	0.07
290	600157	永泰能源	279,329	997,204.53	0.07
291	600500	中化国际	104,290	997,012.40	0.07
292	600317	营口港	288,801	990,587.43	0.07
293	600783	鲁信创投	57,905	986,122.15	0.07

294	601139	深圳燃气	113,424	981,117.60	0.07
295	601616	广电电气	208,634	974,320.78	0.07
296	600662	强生控股	120,666	968,947.98	0.07
297	600742	一汽富维	50,262	960,506.82	0.07
298	600823	世茂股份	194,113	951,153.70	0.07
299	600635	大众公用	173,793	947,171.85	0.07
300	600551	时代出版	59,910	945,978.90	0.07
301	600172	黄河旋风	114,432	941,775.36	0.07
302	600563	法拉电子	18,947	936,171.27	0.07
303	600729	重庆百货	34,873	935,991.32	0.07
304	600268	国电南自	150,529	928,763.93	0.07
305	600801	华新水泥	96,796	922,465.88	0.07
306	600216	浙江医药	93,036	921,986.76	0.07
307	600557	康缘药业	55,375	919,778.75	0.07
308	600636	*ST 爱富	65,739	911,142.54	0.07
309	600307	酒钢宏兴	316,960	903,336.00	0.06
310	600022	山东钢铁	436,249	898,672.94	0.06
311	600875	东方电气	92,599	887,098.42	0.06
312	603369	今世缘	66,640	879,648.00	0.06
313	600096	云天化	118,847	879,467.80	0.06
314	600378	天科股份	71,241	876,976.71	0.06
315	600469	风神股份	116,498	874,899.98	0.06
316	603806	福斯特	26,882	860,492.82	0.06
317	600239	云南城投	162,550	848,511.00	0.06
318	600655	豫园商城	74,841	847,200.12	0.06
319	600288	大恒科技	79,892	846,855.20	0.06
320	600348	阳泉煤业	124,607	844,835.46	0.06
321	600963	岳阳林纸	109,585	825,175.05	0.06
322	600580	卧龙电气	120,473	821,625.86	0.06
323	600759	洲际油气	133,663	809,997.78	0.06
324	600320	振华重工	155,409	805,018.62	0.06
325	600748	上实发展	111,711	804,319.20	0.06
326	600917	重庆燃气	84,521	797,033.03	0.06
327	603328	依顿电子	56,246	795,880.90	0.06
328	600395	盘江股份	107,249	786,135.17	0.06
329	600503	华丽家族	112,993	780,781.63	0.06
330	600058	五矿发展	61,419	762,209.79	0.05
331	600373	中文传媒	32,159	756,058.09	0.05
332	600737	中粮糖业	79,253	748,148.32	0.05

333	600192	长城电工	96,674	747,290.02	0.05
334	600807	天业股份	78,895	743,979.85	0.05
335	601208	东材科技	104,879	738,348.16	0.05
336	600881	亚泰集团	143,565	729,310.20	0.05
337	600657	信达地产	126,511	728,703.36	0.05
338	601016	节能风电	195,228	718,439.04	0.05
339	600052	浙江广厦	141,800	716,090.00	0.05
340	601258	庞大集团	255,083	714,232.40	0.05
341	603000	人民网	54,079	712,220.43	0.05
342	600761	安徽合力	54,166	709,574.60	0.05
343	600778	友好集团	91,531	707,534.63	0.05
344	601717	郑煤机	93,087	702,806.85	0.05
345	600468	百利电气	107,150	696,475.00	0.05
346	600054	黄山旅游	40,621	694,619.10	0.05
347	601666	平煤股份	127,401	671,403.27	0.05
348	600975	新五丰	104,880	671,232.00	0.05
349	600483	福能股份	63,598	659,511.26	0.05
350	600138	中青旅	30,842	649,532.52	0.05
351	600337	美克家居	114,117	644,761.05	0.05
352	600316	洪都航空	39,195	629,863.65	0.05
353	600814	杭州解百	68,919	621,649.38	0.04
354	601369	陕鼓动力	90,909	601,817.58	0.04
355	600261	阳光照明	91,026	598,040.82	0.04
356	601789	宁波建工	122,392	596,049.04	0.04
357	601929	吉视传媒	171,508	593,417.68	0.04
358	600633	浙数文化	29,693	573,668.76	0.04
359	601101	昊华能源	69,165	567,153.00	0.04
360	600582	天地科技	122,526	562,394.34	0.04
361	601886	江河集团	52,694	540,113.50	0.04
362	600039	四川路桥	129,071	536,935.36	0.04
363	600496	精工钢构	110,235	532,435.05	0.04
364	600223	鲁商置业	113,465	528,746.90	0.04
365	600322	天房发展	103,961	525,003.05	0.04
366	601515	东风股份	45,345	512,398.50	0.04
367	600508	上海能源	40,667	474,583.89	0.03
368	600284	浦东建设	43,645	467,874.40	0.03
369	600997	开滦股份	75,995	463,569.50	0.03
370	600371	万向德农	38,690	463,506.20	0.03
371	600123	兰花科创	60,385	460,133.70	0.03

372	601001	大同煤业	86,631	454,812.75	0.03
373	600467	好当家	127,692	435,429.72	0.03
374	600175	美都能源	91,573	398,342.55	0.03
375	600433	冠豪高新	67,678	373,582.56	0.03
376	600830	香溢融通	34,705	342,191.30	0.02
377	600805	悦达投资	45,863	337,093.05	0.02
378	600111	北方稀土	13,982	158,416.06	0.01

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	601200	上海环境	1,987,482.42	0.14
2	600019	宝钢股份	1,955,737.63	0.14
3	600089	特变电工	185,875.08	0.01

注：买入金额按买卖成交金额填列，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	601901	方正证券	4,498,261.25	0.32
2	601857	中国石油	3,037,115.00	0.22
3	601988	中国银行	2,372,448.00	0.17
4	601288	农业银行	2,307,597.00	0.16
5	600036	招商银行	1,895,149.00	0.14
6	600601	方正科技	1,763,681.44	0.13
7	600121	*ST 郑煤	1,335,240.41	0.10
8	600028	中国石化	1,287,649.00	0.09
9	601166	兴业银行	1,282,987.00	0.09
10	601328	交通银行	1,255,042.00	0.09
11	601628	中国人寿	1,238,488.00	0.09
12	601106	*ST 一重	1,108,389.61	0.08
13	600810	神马股份	1,079,389.61	0.08
14	601939	建设银行	999,436.00	0.07
15	601766	中国中车	937,290.00	0.07

16	600519	贵州茅台	933,333.00	0.07
17	601010	文峰股份	837,119.92	0.06
18	601318	中国平安	817,145.00	0.06
19	601519	*ST 智慧	784,668.50	0.06
20	600104	上汽集团	667,555.00	0.05

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	4,129,095.13
卖出股票收入（成交）总额	73,633,928.86

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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：本基金本报告期末未持有国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票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	17,105.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,814.92
5	应收申购款	140,373.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	172,293.95

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：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 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

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
40,412	33,257.45	39,982,728.51	2.97%	1,304,017,212.41	97.03%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	83,689.80	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 7 月 1 日）基金份额总额	9,097,758,651.47
本报告期期初基金份额总额	1,429,614,792.90
本报告期基金总申购份额	147,486,172.62
减:本报告期基金总赎回份额	233,101,024.60
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	1,343,999,940.92

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 《汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日正式生效，韩贤旺先生任该基金的基金经理。
2. 基金管理人于 2017 年 2 月 4 日公告，增聘欧阳沁春先生和杨璿先生担任汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与韩贤旺先生共同管理该基金。
3. 《汇添富鑫利债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 13 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。
4. 基金管理人于 2017 年 3 月 10 日公告，李骁先生任基金管理人副总经理。
5. 《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 15 日正式生效，顾耀强先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。
6. 基金管理人于 2017 年 3 月 16 日公告，增聘吴江宏先生担任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理，与顾耀强先生共同管理该基金。
7. 《汇添富中国高端制造股票型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 20 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。
8. 《汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 14 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。
9. 《汇添富精选美元债债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，何旻先生和高欣先生任该基金的基金经理。
10. 《汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
11. 《汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
12. 《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 15 日正式生效，曾刚先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
13. 基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，聘任郑慧莲女士为汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金和汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。
14. 基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理该基金。
15. 基金管理人 2017 年 6 月 21 日公告，雷鸣先生不再担任汇添富新兴消费股票型证券投资基金的基金经理，由刘伟林先生单独管理该基金。
16. 《汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 6 月 23 日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
17. 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、基金财产的诉讼事项。
本报告期，无涉及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

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。
本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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		267,734,970.18	100.00%	63,082.12	100.00%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
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	2	-	-	-	-	-

国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华泰联合证 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	1,710,095.50	100.00%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证 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。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 2 个交易单元：太平洋证券（上交所单元和深交所单元）。

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 2016 年年度资产净值的公告	公司网站	2017 年 1 月 3 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加奕丰金融为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 1 月 11 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加凤凰金信为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 1 月 13 日
4	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（国际医学、国电南瑞、时代出版、中源协和）	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 1 月 17 日
5	汇添富旗下公募基金 2016 年第 4 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017 年 1 月 19 日
6	汇添富上证综合指数证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 1 号）	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 2 月 14 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金通过盈米财富申购金额下限的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 2 月 21 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的电子渠道申购、定投基金费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 2 月 23 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加联储证券为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 2 月 24 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加泉州银行为	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 2 月 27 日

	代销机构的公告		
11	关于汇添富上证综合指数证券投资基金增加民生证券为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 1 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加苏宁基金为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 2 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加龙江银行为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 7 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告(副总经理)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 10 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与财通证券申购费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 16 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在财通证券开通定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 16 日
17	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加好买基金开展的定投费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 20 日
18	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加肯特瑞财富为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 23 日
19	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加申万宏源开展的申购基金费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 23 日
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加申万宏源西部开展的申购基金费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 23 日
21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金继续参与东亚银行(中国)有限公司开展的定投基金费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 28 日
22	汇添富旗下公募基金 2016 年年度报告及摘要	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017 年 3 月 29 日
23	汇添富基金管理股份有限公司关	中证报, 证券时报,	2017 年 3 月 30 日

	于旗下部分基金继续参与中国工商银行申购基金费率优惠活动的公告	上证报, 公司网站	
24	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加首创证券开展的申购费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 11 日
25	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加首创证券开展的定投费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 11 日
26	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中信建投证券开展的定投费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 14 日
27	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在中银国际证券开通定投业务的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 15 日
28	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的电子渠道申购、定投基金费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 22 日
29	汇添富旗下公募基金 2017 年一季报	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2017 年 4 月 24 日
30	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(当代明诚、中国联通、荣之联)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 25 日
31	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下基金场外申购、定投单笔金额下限及场外最低赎回、转换、保留份额的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 26 日
32	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	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 5 月 11 日
33	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加江苏银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 6 月 9 日
34	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加长量基金开展的定投基金费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 6 月 17 日
35	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加东亚银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 6 月 23 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富上证综合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、报告期内汇添富上证综合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。

12.2 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

12.3 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

2017 年 8 月 26 日