

# 汇添富价值精选混合型证券投资基金 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

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>10</b>
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>54</b>
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.....	54

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富价值精选混合型证券投资基金
基金简称	汇添富价值精选混合
基金主代码	519069
前端交易代码	519069
后端交易代码	519070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 1 月 23 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,370,159,037.23 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选价值相对低估的优质公司股票，在有效管理风险的前提下，追求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	73,272,957.53
本期利润	477,690,194.15
加权平均基金份额本期利润	0.3458
本期加权平均净值利润率	13.81%
本期基金份额净值增长率	14.61%
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	1,726,166,886.83
期末可供分配基金份额利润	1.2598
期末基金资产净值	3,718,188,019.48
期末基金份额净值	2.714
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	374.24%

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

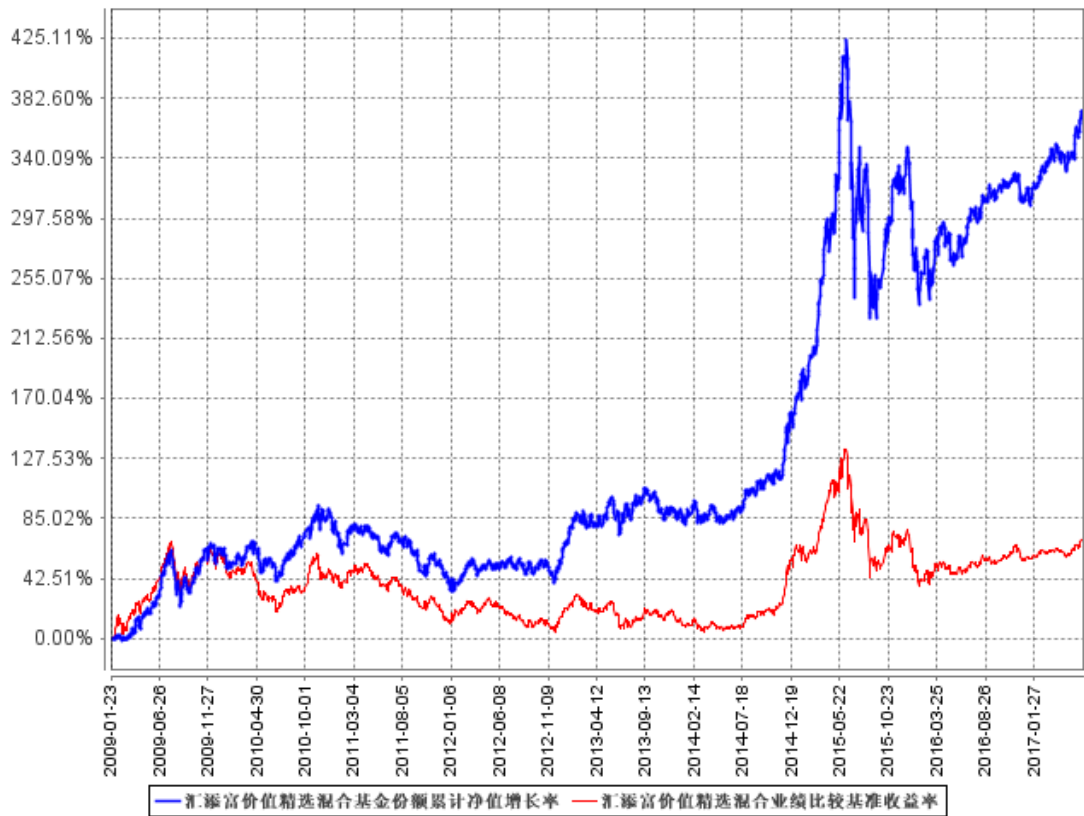
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.89%	0.79%	4.02%	0.54%	2.87%	0.25%
过去三个月	7.70%	0.76%	4.91%	0.49%	2.79%	0.27%
过去六个月	14.61%	0.66%	8.70%	0.45%	5.91%	0.21%
过去一年	21.21%	0.65%	13.36%	0.54%	7.85%	0.11%
过去三年	148.04%	1.70%	58.08%	1.40%	89.96%	0.30%
过去五年	210.66%	1.51%	43.16%	1.26%	167.50%	0.25%



自基金合同生效日起至 今	374.24%	1.45%	70.05%	1.28%	304.19%	0.17%
-----------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

### 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

汇添富价值精选混合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》生效之日起（2009年1月23日）6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立，注册资本为 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		
劳杰男	汇添富价值精选混合基金、汇添富国企创新股票基金的基金经理，研究副总监。	2015年11月18日	-	7年	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010年7月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任研究副总监。2015年7月10日至今任汇添富国企创新股票基金的基金经理，2015年11月18日至今任汇添富价值精选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 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

17 年上半年，市场总体表现良性，行业“白马龙头”为代表的个股涨幅明显，炒概念为主的估值偏高的个股跌幅较大。整体来看，沪深 300 指数上涨 10.78%，同期创业板指数下跌 7.34%。

添富价值在上半年延续“行业相对均衡、个股适度集中、适时动态调整”的风格和思路。行业相对均衡的配置，使得在收益率方面并没有极致的表现。个股方面，坚持自下而上精选个股，结合公司基本面和估值增加了稳健价值类相关个股的配置比重，上半年有不错的表现，偏成长的医药医疗、环保、教育等相关个股对净值有一定拖累。另外，在整体操作方面，基金基本不做大规模的择时操作，注重个股选择和调整，以价值和成长相结合、根据估值水平变化和个股基本面逻辑对组合进行动态调整。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.7140 元；本报告期基金份额净值增长率为 14.61%，业绩比较基准收益率为 8.70%。

## 4.5 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，海外经济复苏仍面临一定的不确定性，国内经济在“L 型”的横向上波动；全球范围内的流动性趋紧，特别是国内的去杠杆任重道远，尽管阶段性会有缓和；在这样的大背景下，权益市场要有大的趋势性行情较难，结构性分化仍是主旋律，自下而上选好个股是主要工作。

操作方面，添富价值仍坚持自下而上优选个股集中，并相对均衡配置资产。向下有安全边际并有不错向上弹性的稳健价值类或稳健成长类个股为核心配置，高成长类个股和周期反转类个股注重“准心”，特别提防买入伪成长概念类个股或周期波动阶段的博弈类个股。行业配置方面，消费升级、先进制造、科技创新、改革等，仍是添富价值主要关注的方向；在各行业中，研究龙头公司并以合理的价格买入以及寻找细分行业的潜在龙头公司是重要方向。

作为机构投资者，我们仍希望能够时刻保持良好且积极的心态，发挥自身在选股和风险控制方面的优势，通过深入研究并寻找具有良好盈利模式和竞争优势、优秀管理团队、合理估值水平的公司，并通过中长期持股来获取长期较好的回报。添富价值看淡短期排名，追求持续稳定增长的较高的年复合收益，尽管短期会有压力；感谢广大投资者的理解和信任。

#### 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：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，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 15%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富价值精选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，汇添富价值精选股票型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富价值精选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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有限公司编制和披露的汇添富价值精选股票型证券投资基金 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：汇添富价值精选混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	284,195,576.60	374,153,113.08
结算备付金		2,381,715.95	3,114,534.66
存出保证金		545,764.29	919,080.50
交易性金融资产	6.4.7.2	3,229,570,192.64	3,020,193,708.09
其中：股票投资		3,119,827,192.64	2,920,283,708.09
基金投资		-	-
债券投资		109,743,000.00	99,910,000.00
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	199,895,339.95	-
应收证券清算款		1,923,657.91	-
应收利息	6.4.7.5	2,374,050.85	2,137,590.03
应收股利		-	-
应收申购款		10,756,870.28	1,401,258.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,731,643,168.47	3,401,919,284.83
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,594,781.49
应付赎回款		6,616,319.46	1,170,657.07
应付管理人报酬		4,460,888.05	4,675,445.71
应付托管费		743,481.36	779,240.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,322,926.93	1,786,426.93



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	311,533.19	413,029.64
负债合计		13,455,148.99	10,419,581.80
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,370,159,037.23	1,432,465,017.48
未分配利润	6.4.7.10	2,348,028,982.25	1,959,034,685.55
所有者权益合计		3,718,188,019.48	3,391,499,703.03
负债和所有者权益总计		3,731,643,168.47	3,401,919,284.83

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.714 元，基金份额总额 1,370,159,037.23 份。

2、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富价值精选混合型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		512,347,795.33	-610,113,279.05
1.利息收入		3,010,196.42	5,394,481.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,455,369.62	2,649,387.41
债券利息收入		1,537,415.08	2,606,690.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		17,411.72	138,403.80
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		104,005,429.45	266,586,379.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	82,966,546.72	242,520,410.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-143,920.00	-717,560.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	21,182,802.73	24,783,529.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	404,417,236.62	-884,615,251.46
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	914,932.84	2,521,111.02
<b>减：二、费用</b>		34,657,601.18	48,219,545.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	25,700,208.14	32,044,051.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,283,368.07	5,340,675.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,470,354.28	10,620,975.53
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	203,670.69	213,843.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		477,690,194.15	-658,332,825.02

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：汇添富价值精选混合型证券投资基金

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）	1,432,465,017.48	1,959,034,685.55	3,391,499,703.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	477,690,194.15	477,690,194.15
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）	-62,305,980.25	-88,695,897.45	-151,001,877.70
其中：1.基金申购款	349,980,906.88	536,792,890.06	886,773,796.94
2.基金赎回款	-412,286,887.13	-625,488,787.51	-1,037,775,674.64
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,370,159,037.23	2,348,028,982.25	3,718,188,019.48

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)	2,266,922,229.23	4,064,773,549.21	6,331,695,778.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-658,332,825.02	-658,332,825.02
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)	-537,307,246.40	-775,104,457.97	-1,312,411,704.37
其中：1.基金申购款	555,186,156.72	669,102,795.34	1,224,288,952.06
2.基金赎回款	-1,092,493,403.12	-1,444,207,253.31	-2,536,700,656.43
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)	-	-488,493,838.11	-488,493,838.11
五、期末所有者权益(基金净值)	1,729,614,982.83	2,142,842,428.11	3,872,457,410.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
张晖	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

汇添富价值精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]1317号文《关于核准汇添富价值精选股票型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1月23日正式生效，首次设立募集规模为1,512,522,680.68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。

本基金坚持长期价值投资的理念，采用深入的“自下而上”的公司基本面分析方法，精选价

值相对低估的优质公司进行投资布局，通过科学的组合管理，实现投资目标。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 1、印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问

题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## 2、营业税、增值税

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；

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以及金融同业往来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，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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。

## 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。

#### 4、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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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	284,195,576.60
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	284,195,576.60

注：本基金本报告期末未投资定期存款。

#### 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	2,655,569,142.20	3,119,827,192.64	464,258,050.44
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	109,813,010.00	109,743,000.00
	合计	109,813,010.00	109,743,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,765,382,152.20	3,229,570,192.64	464,188,040.44

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 6.4.7.4 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

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	199,895,339.95	-
合计	199,895,339.95	-

##### 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	97,689.27
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	964.53
应收债券利息	2,257,764.38
应收买入返售证券利息	17,411.72
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	220.95
合计	2,374,050.85

注：表中“其他”为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本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	1,322,311.98
银行间市场应付交易费用	614.95
合计	1,322,926.93

#### 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	18,136.50
预提信息披露费	248,765.71
审计费用	44,630.98
合计	311,533.19



### 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	1,432,465,017.48	1,432,465,017.48
本期申购	349,980,906.88	349,980,906.88
本期赎回(以“-”号填列)	-412,286,887.13	-412,286,887.13
- 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	1,370,159,037.23	1,370,159,037.23

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 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	1,729,142,507.14	229,892,178.41	1,959,034,685.55
本期利润	73,272,957.53	404,417,236.62	477,690,194.15
本期基金份额交易产生的变动数	-76,248,577.84	-12,447,319.61	-88,695,897.45
其中：基金申购款	430,995,265.39	105,797,624.67	536,792,890.06
基金赎回款	-507,243,843.23	-118,244,944.28	-625,488,787.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,726,166,886.83	621,862,095.42	2,348,028,982.25

### 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
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	18,512.13
其他	15,793.31
合计	1,455,369.62

### 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	1,577,188,428.51
减：卖出股票成本总额	1,494,221,881.79
买卖股票差价收入	82,966,546.72

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-143,920.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-143,920.00

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	102,548,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	100,143,920.00
减：应收利息总额	2,548,000.00
买卖债券差价收入	-143,920.00

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 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	21,182,802.73
基金投资产生的股利收益	-
合计	21,182,802.73

#### 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	404,417,236.62
——股票投资	404,253,326.62
——债券投资	163,910.00
——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	404,417,236.62

#### 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	914,932.84
合计	914,932.84

#### 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	4,469,629.28
银行间市场交易费用	725.00
合计	4,470,354.28

#### 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	44,630.98
信息披露费	148,765.71
银行划款费用	1,274.00
帐户维护费	9,000.00
合计	203,670.69

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

**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	352,213,855.89	12.30%	886,125,940.00	13.41%

**6.4.10.1.2 债券交易**

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.3 权证交易**

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.4 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	323,521.34	12.26%	123,623.98	9.35%
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	812,599.77	13.35%	581,064.24	19.71%

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	25,700,208.14	32,044,051.74
其中：支付销售机构的客户维护费	4,675,334.74	3,702,969.79

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times 1.50\% /$ 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付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、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	4,283,368.07	5,340,675.20

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times 0.25\% /$ 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付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，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：本基金与关联方于本报告期及上年度可比期间均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**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2009 年 1 月 23 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	8,103,322.53	8,103,322.53
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	8,103,322.53	8,103,322.53
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.59%	0.47%

注：本基金于 2009 年 1 月 23 日成立。本公司于 2015 年 7 月 6 日用自有资金 20,000,000.00 元申购本基金 8,103,322.53 份。申购费用 1,000.00 元。符合招募说明书规定的申购费率。

**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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		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	284,195,576.60	1,421,064.18	625,524,271.87	2,573,410.38

**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：本基金本期及上年度可比期间均未参与在承销期内关联方承销证券。

**6.4.11 利润分配情况**

注：本基金在本期内未进行利润分配。

**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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

**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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601717	郑煤机	2017 年 4 月 24 日	重大资产重组	7.55	-	-	21,000,000	172,528,748.95	158,550,000.00	-



			组 停 牌							
--	--	--	-------------	--	--	--	--	--	--	--

### 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银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	79,704,000.00	-
合计	79,704,000.00	-

注：未评级债券为超短期融资券、国债、同业存单、中央银行票据以及政策性金融债。

#### 6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	30,039,000.00	-
合计	30,039,000.00	-

注：未评级债券为国债、同业存单、中央银行票据以及政策性金融债。

#### 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。

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

**6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、部分应收申购款及债券投资等。

**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	284,195,576.60	-	-	-	-	-	284,195,576.60
结算备付金	2,381,715.95	-	-	-	-	-	2,381,715.95
存出保证金	545,764.29	-	-	-	-	-	545,764.29
交易性金融资产	-	-59,958,000.00	49,785,000.00	-	-	-3,119,827,192.64	3,229,570,192.64
买入返售金融资产	199,895,339.95	-	-	-	-	-	199,895,339.95
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,923,657.91	1,923,657.91
应收利息	-	-	-	-	-	2,374,050.85	2,374,050.85
应收申购款	3,109,865.81	-	-	-	-	7,647,004.47	10,756,870.28
资产总计	490,128,262.60	59,958,000.00	49,785,000.00	-	-	-3,131,771,905.87	3,731,643,168.47
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,616,319.46	6,616,319.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,460,888.05	4,460,888.05
应付托管费	-	-	-	-	-	743,481.36	743,481.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,322,926.93	1,322,926.93
其他负债	-	-	-	-	-	311,533.19	311,533.19
负债总计	-	-	-	-	-	13,455,148.99	13,455,148.99
利率敏感度缺口	490,128,262.60	59,958,000.00	49,785,000.00	-	-	-3,118,316,756.88	3,718,188,019.48
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	374,153,113.08	-	-	-	-	-	374,153,113.08
结算备付金	3,114,534.66	-	-	-	-	-	3,114,534.66
存出保证金	919,080.50	-	-	-	-	-	919,080.50
交易性金融资产	40,000,000.00	-	-59,910,000.00	-	-	-2,920,283,708.09	3,020,193,708.09

资产							
应收利息	-	-	-	-	-	2,137,590.03	2,137,590.03
应收申购款	488,717.60	-	-	-	-	912,540.87	1,401,258.47
资产总计	418,675,445.84	-59,910,000.00	-	-	-	-2,923,333,838.99	3,401,919,284.83
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,594,781.49	1,594,781.49
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,170,657.07	1,170,657.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,675,445.71	4,675,445.71
应付托管费	-	-	-	-	-	779,240.96	779,240.96
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,786,426.93	1,786,426.93
其他负债	-	-	-	-	-	413,029.64	413,029.64
负债总计	-	-	-	-	-	10,419,581.80	10,419,581.80
利率敏感度缺口	418,675,445.84	-59,910,000.00	-	-	-	-2,912,914,257.19	3,391,499,703.03

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

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。		
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）
	基准利率增加 25 个基点	-107,729.80	-47,810.69
基准利率减少 25 个基点	108,039.47	47,881.30	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 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	3,119,827,192.64	83.91	2,920,283,708.09	86.11
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	109,743,000.00	2.95	99,910,000.00	2.95
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	3,229,570,192.64	86.86	3,020,193,708.09	89.06

注：本基金股票投资占基金资产的比例为 60-95%，现金、债券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5-40%，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表所示。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 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；		
	2. 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）
	沪深 300 指数上涨 5%	150,912,797.80	152,884,943.54
	沪深 300 指数下跌 5%	-150,912,797.80	-152,884,943.54

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	3,119,827,192.64	83.60
	其中：股票	3,119,827,192.64	83.60
2	固定收益投资	109,743,000.00	2.94
	其中：债券	109,743,000.00	2.94
	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	199,895,339.95	5.36
	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	286,577,292.55	7.68
7	其他各项资产	15,600,343.33	0.42
8	合计	3,731,643,168.47	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末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	72,815,717.46	1.96
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,576,439,073.02	42.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	56,200,000.00	1.51
F	批发和零售业	102,699,401.60	2.76
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	105,907,639.62	2.85
J	金融业	782,605,462.54	21.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	337,279,898.40	9.07

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	85,880,000.00	2.31
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,119,827,192.64	83.91

### 7.2.2 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持有港股通投资。

### 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	601318	中国平安	5,000,735	248,086,463.35	6.67
2	000826	启迪桑德	7,000,000	245,840,000.00	6.61
3	002415	海康威视	6,500,000	209,950,000.00	5.65
4	600036	招商银行	8,400,465	200,855,118.15	5.40
5	002271	东方雨虹	5,206,401	193,157,477.10	5.19
6	000333	美的集团	3,700,900	159,286,736.00	4.28
7	601717	郑煤机	21,000,000	158,550,000.00	4.26
8	601169	北京银行	17,002,972	155,917,253.24	4.19
9	300408	三环集团	7,400,000	155,326,000.00	4.18
10	300003	乐普医疗	5,700,000	126,027,000.00	3.39
11	000651	格力电器	2,944,991	121,245,279.47	3.26
12	600406	国电南瑞	6,000,000	105,900,000.00	2.85
13	600519	贵州茅台	199,919	94,331,780.15	2.54
14	002008	大族激光	2,700,000	93,528,000.00	2.52
15	601688	华泰证券	5,220,482	93,446,627.80	2.51
16	600697	欧亚集团	3,300,760	92,949,401.60	2.50
17	000888	峨眉山 A	7,199,992	91,439,898.40	2.46
18	600867	通化东宝	4,800,000	87,552,000.00	2.35
19	600661	新南洋	4,000,000	85,880,000.00	2.31
20	601166	兴业银行	5,000,000	84,300,000.00	2.27
21	000590	启迪古汉	5,000,000	81,150,000.00	2.18
22	002508	老板电器	1,702,018	74,003,742.64	1.99
23	000711	京蓝科技	4,835,041	72,815,717.46	1.96



24	600068	葛洲坝	5,000,000	56,200,000.00	1.51
25	600426	华鲁恒升	1,700,066	19,958,774.84	0.54
26	600827	百联股份	600,000	9,750,000.00	0.26
27	000925	众合科技	100,000	2,077,000.00	0.06
28	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
29	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
30	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
31	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
32	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
33	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
34	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
35	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
36	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
37	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
38	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
39	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
40	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
41	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
42	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

## 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	601318	中国平安	136,963,836.66	4.04
2	000333	美的集团	132,720,535.13	3.91
3	601688	华泰证券	94,903,931.73	2.80
4	600036	招商银行	85,817,409.71	2.53
5	000651	格力电器	85,504,060.01	2.52
6	002508	老板电器	73,701,073.80	2.17
7	600827	百联股份	71,547,744.26	2.11
8	600519	贵州茅台	69,922,251.83	2.06
9	601169	北京银行	63,852,151.52	1.88
10	002008	大族激光	55,905,058.84	1.65
11	002271	东方雨虹	44,718,894.54	1.32
12	000711	京蓝科技	37,375,919.82	1.10

13	002714	牧原股份	34,128,626.62	1.01
14	600028	中国石化	32,089,400.02	0.95
15	000630	铜陵有色	27,909,346.20	0.82
16	601888	中国国旅	26,285,583.52	0.78
17	601919	中远海控	24,792,220.62	0.73
18	600428	中远海特	24,783,988.13	0.73
19	600820	隧道股份	23,095,061.48	0.68
20	600697	欧亚集团	20,364,764.88	0.60

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	300408	三环集团	121,323,621.28	3.58
2	600208	新潮中宝	96,060,927.77	2.83
3	002008	大族激光	94,116,771.55	2.78
4	300136	信维通信	77,889,140.96	2.30
5	601166	兴业银行	76,869,560.50	2.27
6	000925	众合科技	74,892,509.92	2.21
7	600827	百联股份	71,449,154.31	2.11
8	002589	瑞康医药	69,477,071.74	2.05
9	600894	广日股份	63,455,415.73	1.87
10	000608	阳光股份	61,098,974.96	1.80
11	300003	乐普医疗	60,101,134.78	1.77
12	600820	隧道股份	58,370,769.20	1.72
13	600487	亨通光电	57,941,750.19	1.71
14	601717	郑煤机	56,057,898.27	1.65
15	600068	葛洲坝	55,829,703.67	1.65
16	000630	铜陵有色	54,705,654.24	1.61
17	002415	海康威视	53,745,250.47	1.58
18	600697	欧亚集团	46,724,456.93	1.38
19	000711	京蓝科技	35,249,542.69	1.04
20	002714	牧原股份	34,210,437.49	1.01

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	1,289,512,039.72
卖出股票收入（成交）总额	1,577,188,428.51

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

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	109,743,000.00	2.95
	其中：政策性金融债	109,743,000.00	2.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	109,743,000.00	2.95

### 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

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	170204	17 国开 04	500,000	49,785,000.00	1.34
2	140220	14 国开 20	300,000	30,039,000.00	0.81
3	160214	16 国开 14	300,000	29,919,000.00	0.80

### 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**

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**

注：本基金本报告期内未持有国债期货投资。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1**

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**

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	545,764.29
2	应收证券清算款	1,923,657.91
3	应收股利	-
4	应收利息	2,374,050.85
5	应收申购款	10,756,870.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,600,343.33

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601717	郑煤机	158,550,000.00	4.26	重大资产重组停牌

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
109,147	12,553.34	268,015,039.57	19.56%	1,102,143,997.66	80.44%

### 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	3,083,451.04	0.23%

### 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	>100
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 1 月 23 日）基金份额总额	1,512,522,680.68
本报告期期初基金份额总额	1,432,465,017.48
本报告期基金总申购份额	349,980,906.88
减：本报告期基金总赎回份额	412,286,887.13
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	1,370,159,037.23

注：表内“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网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网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	
民生证券	1	403,142,490.18	14.08%	375,445.91	14.23%	-
太平洋证券	2	379,213,240.17	13.24%	350,200.41	13.27%	-
东方证券	2	352,213,855.89	12.30%	323,521.34	12.26%	-
中金公司	2	290,951,249.69	10.16%	268,406.58	10.17%	-
华创证券	1	275,335,575.17	9.62%	250,913.90	9.51%	-
招商证券	2	249,280,877.07	8.71%	229,897.43	8.71%	-
银河证券	1	245,863,639.84	8.59%	228,971.36	8.68%	-
国金证券	2	219,096,885.07	7.65%	199,663.15	7.57%	-
国泰君安	2	144,231,319.74	5.04%	134,313.93	5.09%	-
海通证券	2	106,859,642.32	3.73%	97,619.66	3.70%	-
天风证券	2	96,818,629.93	3.38%	88,238.61	3.34%	-
广发证券	2	65,531,901.04	2.29%	59,718.70	2.26%	-



中信证券	2	34,409,545.17	1.20%	31,358.02	1.19%	-
国信证券	2	201,324.60	0.01%	187.49	0.01%	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
中国中投	2	-	-	-	-	-
上海华信证 券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	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
民生证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
中国中投	-	-	-	-	-	-
上海华信证 券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

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。
- (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：

本基金报告期内新增 1 家证券公司的 2 个交易单元：方正证券（深交所单元和上交所单元）

### 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	中证报, 证券时报,	2017 年 1 月 11 日

	于旗下部分基金增加奕丰金融为 代销机构的公告	上证报, 公司网站	
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	关于汇添富价值精选混合型证券 投资基金参与华夏银行定投费率 优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 1 月 14 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 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
6	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
7	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
8	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
9	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 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 27 日
10	汇添富价值精选混合型证券投资 基金更新招募说明书(2017 年第 1 号)	中证报, 上交所, 证 券时报, 上证报, 公 司网站	2017 年 3 月 2 日
11	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
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(副 总经理)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 10 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于 旗下部分基金参加国都证券开 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 13 日
14	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
15	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	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 3 月 16 日

	动的公告		
16	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
17	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
18	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
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
20	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
21	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
22	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中国工商银行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 30 日
23	关于汇添富价值精选混合型证券投资基金在国海证券调整定投起点的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 11 日
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
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
26	关于汇添富价值精选混合型证券投资基金在海通证券调整定投起点的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 4 月 13 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
28	汇添富基金管理股份有限公司关	中证报, 证券时报,	2017 年 4 月 15 日

	于旗下部分基金在中银国际证券 开通定投业务的公告	上证报, 公司网站	
29	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
30	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
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 旗下部分基金增加联储证券为 代销机构并参加费率优惠活动的 公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 5 月 25 日
34	汇添富基金管理股份有限公司关于 旗下部分基金在银河证券开通 定投并参加申购、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 6 月 9 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
36	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
37	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价值精选混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富价值精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富价值精选混合型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、报告期内汇添富价值精选混合型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](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2017 年 8 月 26 日