

汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券
投资基金
2017 年半年度报告

2017 年 06 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 08 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及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责任。本半年度报告已经三分之二独立董事签字同意，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、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月25日(基金合同生效日)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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	39
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	41

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细	44
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	44
7.11 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
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
§ 9 开放式基金份额变动	45
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	汇添富全球互联混合(QDII)
基金主代码	001668
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月25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	195,379,905.08 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球移动互联主题相关公司的股票，通过对投资对象的精选和组合管理，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金资产配置策略及股票投资策略适用于境内市场投资、境外市场投资及港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票的投资。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出全球移动互联主题相关公司中商业模式清晰、竞争优势明显、具有长期持续增长模式且估值水平相对合理的上市公司，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。
业绩比较基准	50%*人民币计价的中证海外中国互联网指数收益率+50%*中证移动互联网指数收益率
风险收益特征	本基金为主要投资于全球移动互联主题相关公司股票混合型基金，属于证券投资基金中高预期风险高预期收益的品种，其预期风险与预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

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号震旦国际大厦 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 境外投资顾问和境外资产托管人

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

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

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楼汇添富基金管理有限公司

2.6 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	2017年01月25日（基金合同生效日）-2017年06月30日
本期已实现收益	10,075,781.18
本期利润	28,856,781.95
加权平均基金份额本期利润	0.1347
本期加权平均净值利润率	12.61%
本期基金份额净值增长率	17.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017年06月30日）
期末可供分配利润	15,249,169.76
期末可供分配基金份额利润	0.0780

期末基金资产净值	229,410,511.86
期末基金份额净值	1.174
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年06月30日)
基金份额累计净值增长率	17.40%

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，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。

4、本基金的《基金合同》生效日为2017年1月25日，至本报告期末未满半年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2017年6月30日数据，特此说明。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.69%	0.70%	3.66%	0.83%	-2.97%	-0.13%
过去三个月	13.10%	0.80%	5.43%	0.81%	7.67%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	17.40%	0.65%	13.23%	0.74%	4.17%	-0.09%

注：本《基金合同》生效日期为2017年1月25日，截止至报告期末，基金成立未满6个月。

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

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本《基金合同》生效日期为 2017 年 1 月 25 日，截止至报告期末，基金成立未满 6 个月。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017 年 1 月 25 日）起 6 个月，截止至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

§ 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		
韩贤旺	汇添富外延增长主题股票基金、汇添富全球移动互联网混合基金的基金经理，首席经济学家。	2017年1月25日		19年	国籍：中国。学历：复旦大学经济学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任君安证券有限责任公司分析师、天同证券有限责任公司研究所所长助理、行业部经理、国联安基金管理有限公司研究主管、平安资产管理有限公司股票研究主管。2007年5月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任首席经济学家，2012年3月2日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合基金的基金经理，2014年12月8日至今任汇添富外延增长股票基金的基金经理，2017年1月25日至今任汇添富全球移动互联网混合基金的基金经理。
欧阳沁春	汇添富社会责任混合基金、汇添富移动互联网股票基金、汇添富全球移动互联网混合基金的基金经理，移动互联网行业投资总监。	2017年1月25日		16年	国籍：中国。学历：卫生部武汉生物制品研究所医学硕士、中欧国际工商学院工商管理硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任卫生部武汉生物制品研究所助理研究员、中国网络（百慕大）有限公司项目经理、大成基金管理有限公司行业研究员、国联安基金管理有限

					公司行业研究员，2006年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任移动互联网行业投资总监，2007年6月18日至2012年3月2日任汇添富均衡增长混合基金的基金经理，2011年3月29日至今任汇添富社会责任混合基金的基金经理，2014年8月26日至今任汇添富移动互联股票基金的基金经理，2017年1月25日至今任汇添富全球移动互联混合基金的基金经理。
杨璿	汇添富全球移动互联混合基金的基金经理	2017年1月25日		7年	国籍：中国。学历：清华大学工程学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司，2010年8月至2017年1月担任公司的TMT行业分析师，2017年1月25日至今任汇添富全球移动互联混合基金的基金经理。

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规

规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的交易次数为 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在基金的二季度投资策略中，我们一方面继续优选全球移动互联网行业的核心发展脉络及相关的核心龙头企业，另一方面努力挖掘在中国消费升级背景下，受益的子行业、个股，作为风格池外的补充配置。

我们认为未来的科技行业，是在人工智能与云计算为基础设施的广义物联网应用，人工智能与云计算将是渗入行业方方面面的基础工具，而基于此的智能手机、智能驾驶汽车、机器人、智能家居等应用将逐渐展开。

在智能手机流量成长的中后期，移动应用的成长驱动力将主要来源于精细化深耕用户带来的单用户价值增长，特别是带有平台粘性或长期数据积累的企业拥有极强的竞争优势。此外，视频在广告、社交、娱乐等领域都将替代文字、图片，成为最主要的互联网消费内容。我们也非常看

好二胎放开、优质教育资源稀缺背景下，民办教育市场的快速增长，及品牌化、规模化、规范化经营的趋势。

在云计算、人工智能、广义物联网领域，我们挑选那些在全球范围内具备极强竞争优势、可持续性经营能力较强、被颠覆或复制风险较低的龙头企业，进行中长期的布局。

在中国消费升级的大背景下，普通消费、娱乐消费，甚至与之相关的IT工具、原材料、生产设备等都在进行潜移默化的升级，我们选取行业内符合产业趋势、管理团队优秀的龙头企业进行中长期布局。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

二季度以来，美股与H股市场表现较好，A股虽然在4-5月有一定的下跌，但整体仍有明显的结构性行情。截至6月30日的三个月期间，A股上证综指下跌0.93%、深证成指上涨0.97%、沪深300上涨6.1%、创业板指数下跌4.68%；恒生指数上涨6.86%、恒生国企指数上涨0.89%、恒生中国100指数上涨4.64%；道琼斯指数上涨3.32%、纳斯达克指数上涨3.87%、标普500指数上涨2.57%。

基金在二季度上涨13.10%，主要受益于互联网、教育、消费行业龙头个股的较好表现，以及整体市场的上涨。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美联储有可能在今年Q3末或Q4初开始缩表，尽管初期的实质影响不大，但对市场情绪或有一定影响。加上今年美股普遍涨幅较大的情况下，三季度再出现大幅上涨的可能性相对较小，但由于企业微观层面的基本面仍相当强劲，即便出现普遍回调，我们认为幅度也是相对有限的。中长期，我们仍然非常看好美国与中国这两个韧性较强、层次丰富、抗风险能力强的经济体。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、基金营运部和稽核监察部人员组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有丰富的证券基金行业从业经验，能够胜任估值决策工作，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理不介入基金日常估

值业务，但可以参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国工商银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金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：汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年06月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	92,894,052.55
结算备付金		4,752,654.63
存出保证金		221,381.67
交易性金融资产	6.4.7.2	150,325,048.42
其中：股票投资		150,325,048.42
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	7,989.95
应收股利		10,059.98
应收申购款		1,325,501.23
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		249,536,688.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年06月30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		2,117,413.02
应付赎回款		17,352,970.30
应付管理人报酬		347,997.44
应付托管费		67,666.17
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	63,118.25

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	177,011.39
负债合计		20,126,176.57
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	195,379,905.08
未分配利润	6.4.7.10	34,030,606.78
所有者权益合计		229,410,511.86
负债和所有者权益总计		249,536,688.43

- 注：1. 报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.174元，基金份额总额229,410,511.86。
2. 本基金合同生效日为2017年1月25日，2017年度实际报告期间为2017年1月25日至2017年6月30日。截至本报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无上年度可比期间数据。
3. 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：汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月25日（基金合同生效日）至2017年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年01月25日（基金合同生效日） 至2017年06月30日
一、收入		31,542,591.78
1. 利息收入		181,709.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	109,631.43
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		72,077.96
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,391,270.25
其中：股票投资收益	6.4.7.12	12,069,218.86
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-

股利收益	6.4.7.17	322,051.39
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	18,781,000.77
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-728,053.49
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.19	916,664.86
减:二、费用		2,685,809.83
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,766,993.45
2.托管费	6.4.10.2.2	343,582.06
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-
4.交易费用	6.4.7.20	410,133.20
5.利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用	6.4.7.21	165,101.12
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		28,856,781.95

注:1. 本基金合同生效日为2017年1月25日,2017年度实际报告期间为2017年1月25日至2017年6月30日。截至本报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无上年度可比期间数据。

2. 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:汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2017年01月25日(基金合同生效日)至2017年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2017年01月25日(基金合同生效日)至2017年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	268,156,205.81	-	268,156,205.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	28,856,781.95	28,856,781.95
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)	-72,776,300.73	5,173,824.83	-67,602,475.90
其中:1.基金申购	155,997,741.64	24,708,347.33	180,706,088.97

款			
2. 基金赎回款	-228,774,042.37	-19,534,522.50	-248,308,564.87
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)	195,379,905.08	34,030,606.78	229,410,511.86

注：本基金合同生效日为2017年1月25日，2017年度实际报告期间为2017年1月25日至2017年6月30日。截至本报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无上年度可比期间数据。

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：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2016]2979号文《关于核准汇添富全球移动互联灵活配置混合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股份有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2017年1月25日正式生效，首次设立募集规模为268,156,205.81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和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，境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman &Co.)。

本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(以下无特别说明，均包括exchange traded fund,ETF);已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、

期权、期货等金融衍生产品、结构性投资产品；本基金还可投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具，具体包括：股票（包含中小板、创业板、其他依法上市的股票）、股指期货、权证、债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金；法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金为对冲外币的汇率风险，可以投资于外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。本基金可以进行证券借贷交易，有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。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。

本基金资产配置策略及股票投资策略适用于境内市场投资、境外市场投资及港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票的投资。本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，通过分析全球经济形势、经济结构特征、地区及产业竞争优势以及股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出全球移动互联主题相关公司中商业模式清晰、竞争优势明显、具有长期持续增长模式且估值水平相对合理的上市公司，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。

本基金业绩比较基准为： $50\% \times \text{人民币计价的中证海外中国互联网指数收益率} + 50\% \times \text{中证移动互联网指数收益率}$

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》、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年1月25日（基金合同生效日）至6月30日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类 本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资等；本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、存出保证金和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类 本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认 本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项

及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认 当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移 本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.80%的年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.35%的年费率计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人

利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

于估值日，外币货币性项目采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入当期损益。以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额，作为公允价值变动的一部分直接计入当期损益。

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

6.4.4.13 分部报告

本基金的基金管理人以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定本基金的经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需进行分部报告的披露。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

根据财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得

税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税；
- (2) 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) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；
- (4) 基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 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06月30日
活期存款	92,894,052.55
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	92,894,052.55

注：1、本基金于2017年6月30日，银行存款中包含的外币余额为：美元1,838,499.36元（折合人民币12,454,730.06元）。

2、本基金本报告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06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	131,544,047.65	150,325,048.42	18,781,000.77
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	131,544,047.65	150,325,048.42	18,781,000.77

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/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06月30日
应收活期存款利息	7,579.78
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	404.97
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借利息	-
其他	5.20
合计	7,989.95

注：“其他”指交易所结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注:本基金本报告期末持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
交易所市场应付交易费用	63,118.25
银行间市场应付交易费用	-
合计	63,118.25

6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	20,472.97
预提费用	156,538.42
合计	177,011.39

6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2017年01月25日(基金合同生效日)至2017年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	268,156,205.81	268,156,205.81
本期申购	155,997,741.64	155,997,741.64
本期赎回(以“-”号填列)	-228,774,042.37	-228,774,042.37
-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	195,379,905.08	195,379,905.08

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
基金合同生效日	-	-	-

本期利润	10,075,781.18	18,781,000.77	28,856,781.95
本期基金份额交易产生的变动数	5,173,388.58	436.25	5,173,824.83
其中：基金申购款	9,286,069.66	15,422,277.67	24,708,347.33
基金赎回款	-4,112,681.08	-15,421,841.42	-19,534,522.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,249,169.76	18,781,437.02	34,030,606.78

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月25日(基金合同生效日)至2017 年06月30日
活期存款利息收入	105,110.82
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	3,205.33
其他	1,315.28
合计	109,631.43

注：“其他”为直销申购款和交易保证金利息收入。

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01月25日(基金合同生效日)至2017 年06月30日
卖出股票成交总额	223,643,483.67
减：卖出股票成本总额	211,574,264.81
买卖股票差价收入	12,069,218.86

6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期末投资基金。

6.4.7.14 债券投资收益

注：本基金本报告期末投资债券。

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末投资资产支持证券。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.16 衍生工具收益

注：本基金本报告期末投资衍生工具。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月25日（基金合同生效日）至2017 年06月30日
股票投资产生的股利收益	322,051.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	322,051.39

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年01月25日（基金合同生效日）至2017 年06月30日
1. 交易性金融资产	18,781,000.77
——股票投资	18,781,000.77
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	18,781,000.77

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月25日（基金合同生效日）至2017 年06月30日
基金赎回费收入	916,664.86
其他	-
合计	916,664.86

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月25日(基金合同生效日)至2017 年06月30日
交易所市场交易费用	410,133.20
银行间市场交易费用	-
合计	410,133.20

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月25日(基金合同生效日)至2017 年06月30日
审计费用	36,832.20
信息披露费	119,706.22
证券组合费/港股通证券组合费	651.26
银行费用	50.00
其他	7,861.44
合计	165,101.12

6.4.7.22 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作。

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

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、基金注册登记机构、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
布朗兄弟哈里曼银行	基金境外托管人

(Brown Brothers Harriman & Co.)	
---------------------------------	--

注：下述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01月25日（基金合同生效日）至2017年06月30日	
	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	133,652,704.07	23.58%

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 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月25日（基金合同生效日）至2017年06月30日	
	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	154,800,000	100%

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本期未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本期未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.6 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01月25日（基金合同生效日）至 2017年06月30日	
	当期佣金	占当期佣金总量的比例
东方证券股份有限公司	128,773.86	43.33%

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01月25日（基金合同生效日）至 2017年06月30日	
	当期发生的基金应支付的管理费	1,766,993.45
其中：支付销售机构的客户维护费	770,383.73	

注：基金管理费按前一日基金资产净值的1.8%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

R 为基金管理费率

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月25日（基金合同生效日）至 2017年06月30日	
	当期发生的基金应支付的托管费	343,582.06

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.35%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

R 为基金托管费年费率

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前5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：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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01月25日（基金合同生效日）至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	80,439,636.48	49,990.18
布朗兄弟哈里曼银行	12,454,416.07	53,838.05

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末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：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注:本基金本期末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。本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不超过基金资产净值的10%,且同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构10%以上具有投票权的证券发行总量。此外,基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%,其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。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,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。本基金所持证券均在证券交易所上市;因此,本基金资产均能及时变现。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 06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	92,894,052.55	-	-	-	-	-	92,894,052.55
备付金	4,752,654.63	-	-	-	-	-	4,752,654.63
存出保证金	221,381.67	-	-	-	-	-	221,381.67
交易性金融资产	-	-	-	-	-	150,325,048.42	150,325,048.42
应收股利	-	-	-	-	-	10,059.98	10,059.98
应收利息	-	-	-	-	-	7,989.95	7,989.95
应收申购款	489,639.20	-	-	-	-	835,862.03	1,325,501.23
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	98,357,728.05	-	-	-	-	151,178,960.38	249,536,688.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	17,352,970.30	17,352,970.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	347,997.44	347,997.44

应付托管费	-	-	-	-	-	67,666.17	67,666.17
应付交易费用	-	-	-	-	-	63,118.25	63,118.25
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,117,413.02	2,117,413.02
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	177,011.39	177,011.39
负债总计	-	-	-	-	-	20,126,176.57	20,126,176.57
利率敏感度缺口	98,357,728.05	-	-	-	-	-131,052,783.81	229,410,511.86

注：上表统计了本基金资产及负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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：本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、部分应收申购款，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，因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	12,454,730.06	-	-	12,454,730.06
存出保证金	-	-	-	-

交易性金融资产	97,964,992.12	25,637,874.24	-	123,602,866.36
应收股利	10,059.98	-	-	10,059.98
应收利息	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	110,429,782.16	25,637,874.24	-	136,067,656.40
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	110,429,782.16	25,637,874.24	-	136,067,656.40

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑管理人人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。	
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06月30日）
-	港币相对人民币升值5%	1,281,893.71
-	港币相对人民币贬值5%	-1,281,893.71
-	美元相对人民币升值5%	5,521,489.11
-	美元相对人民币贬值5%	-5,521,489.11

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值

或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。另外还可投资于债券、基金、金融衍生工具、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，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 其他价格风险的敏感性分析

注：于2017年6月30日，本基金成立未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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	150,325,048.42	60.24
	其中：普通股	150,325,048.42	60.24
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	97,646,707.18	39.13
8	其他各项资产	1,564,932.83	0.63
9	合计	249,536,688.43	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为25,637,874.24人民币，占期末净值比例11.18%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	97,964,992.12	42.70
中国	26,722,182.06	11.65
香港	25,637,874.24	11.18
合计	150,325,048.42	65.53

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	1,315,800.00	0.57
25 非必需消费品	42,839,808.17	18.67
30 必需消费品	16,387,620.00	7.14
35 医疗保健	-	-
40 金融	1,488,300.00	0.65
45 信息技术	88,293,520.25	38.49
50 电信服务	-	-
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	150,325,048.42	65.53

注：1. 以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

2. 由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	-	BABA US	纽约证券交易所	美国	20,490.00	19,557,970.55	8.53
2	TENCENT HOLDINGS LTD	-	700 HK	香港联合交易所	香港	64,500.00	15,629,850.53	6.81
3	NEW ORIENTAL EDUCATION-S P ADR	-	EDU US	纽约证券交易所	美国	28,898.00	13,799,588.42	6.02
4	-	贵州茅台	600519 SH	上海证券交易所	中国	17,200.00	8,115,820.00	3.54
5	TAL	-	TAL US	纽约证券	美国	8,650.00	7,167,18	3.12

	EDUCATION GROUP			交易所			9.87	
6	CHINA LODGING GROUP-SPON ADS	-	HTHT UW	纳斯达克证券交易所	美国	12,400.00	6,777,326.54	2.95
7	BAOZUN INC-SPN ADR	-	BZUN UW	纳斯达克证券交易所	美国	42,200.00	6,337,952.51	2.76
8	-	永辉超市	601933 SH	上海证券交易所	中国	700,000.00	4,956,000.00	2.16
9	SALESFORCE.COM INC	-	CRM US	纽约证券交易所	美国	7,500.00	4,399,972.80	1.92
10	FACEBOOK INC-A	-	FB UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,060.00	4,152,563.58	1.81
11	ADOBE SYSTEMS INC	-	ADBE UW	纳斯达克证券交易所	美国	4,200.00	4,024,318.77	1.75
12	-	大华股份	002236 SZ	深圳证券交易所	中国	174,926.00	3,990,062.06	1.74
13	MAN WAH HOLDINGS LTD	-	1999 HK	香港联合交易所	香港	624,400.00	3,798,924.03	1.66
14	YYY INC-ADR	-	YY US	纽约证券交易所	美国	9,200.00	3,616,689.57	1.58
15	AMAZON.COM INC	-	AMZN UW	纳斯达克证券交易所	美国	550.00	3,606,690.56	1.57
16	BROADCOM LTD	-	AVGO UW	纳斯达克证券交易所	美国	2,255.00	3,560,135.19	1.55
17	ALPHABET INC-CL A	-	GOOGL UW	纳斯达克证券交易所	美国	555.00	3,495,403.43	1.52
18	-	涪陵榨菜	002507 SZ	深圳证券交易所	中国	295,000.00	3,315,800.00	1.45
19	AAC TECHNOLOGIES HOL	-	2018 HK	香港联合交易所	香港	35,000.00	2,964,814.72	1.29
20	MOMO INC-SPON ADR	-	MOMO UW	纳斯达克证券交易所	美国	10,000.00	2,503,818.24	1.09
21	NETEASE	-	NTES US	纽约证券	美国	1,200.00	2,443,90	1.07

	INC-ADR			交易所			5.45	
22	VISA INC-CLASS A SHARES	-	V US	纽约证券 交易所	美国	3,815.00	2,423,68 1.83	1.06
23	COHERENT INC	-	COHR UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,505.00	2,293,87 9.25	1.00
24	COGNEX CORP	-	CGNX UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,900.00	2,243,07 1.58	0.98
25	IGG Inc	-	799 HK	香港联合 交易所	香港	200,000.00	2,089,95 1.36	0.91
26	-	尚品宅配	300616 SZ	深圳证券 交易所	中国	15,000.00	2,033,40 0.00	0.89
27	PRICELINE GROUP INC/THE	-	PCLN UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	150.00	1,900,74 7.60	0.83
28	-	中国国旅	601888 SH	上海证券 交易所	中国	50,000.00	1,507,00 0.00	0.66
29	-	中国平安	601318 SH	上海证券 交易所	中国	30,000.00	1,488,30 0.00	0.65
30	APPLE INC	-	AAPL UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	1,350.00	1,317,12 6.27	0.57
31	-	立讯精密	002475 SZ	深圳证券 交易所	中国	45,000.00	1,315,80 0.00	0.57
32	CYPRESS SEMICONDUCT OR CORP	-	CY UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	13,500.00	1,248,35 2.56	0.54
33	HISENSE KELON ELEC H	-	921 HK	香港联合 交易所	香港	100,000.00	1,154,33 3.60	0.50
34	CTRP.COM INTERNATION AL-ADR	-	CTRP UW	纳斯达克 证券交易 所	美国	3,000.00	1,094,60 7.55	0.48

注：本表所使用的境外证券代码为彭博代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净 值比例(%)
1	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	BABA US	21,394,038.26	9.33
2	ALPHABET INC-CL A	GOOGL UW	20,487,368.89	8.93

3	NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	EDU US	20,145,440.70	8.78
4	BROADCOM LTD	AVGO UW	19,397,155.68	8.46
5	CTrip.COM INTERNATIONAL-ADR	CTRP UW	17,684,977.44	7.71
6	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	14,550,701.16	6.34
7	大华股份	002236 SZ	12,974,416.78	5.66
8	INPHI CORP	IPHI US	12,081,663.37	5.27
9	MOMO INC-SPON ADR	MOMO UW	11,416,272.90	4.98
10	NETEASE INC-ADR	NTES US	10,802,844.46	4.71
11	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	10,297,862.29	4.49
12	APPLE INC	AAPL UW	10,289,333.60	4.49
13	TAL EDUCATION GROUP	TAL US	10,251,581.97	4.47
14	CHINA LODGING GROUP-SPON ADS	HTHT UW	9,904,371.30	4.32
15	AAC TECHNOLOGIES HOL	2018 HK	8,966,989.47	3.91
16	YYY INC-ADR	YY US	8,840,702.19	3.85
17	贵州茅台	600519 SH	8,763,352.05	3.82
18	MAN WAH HOLDINGS LTD	1999 HK	7,540,308.63	3.29
19	COHERENT INC	COHR UW	7,519,008.49	3.28
20	PRICELINE GROUP INC/THE	PCLN UW	7,442,711.22	3.24
21	BAIC MOTOR	1958 HK	7,283,971.39	3.18
22	ANALOG DEVICES INC	ADI UW	5,710,603.67	2.49
23	BAOZUN INC-SPN ADR	BZUN UW	5,636,945.01	2.46
24	QUALCOMM INC	QCOM UW	5,612,124.48	2.45
25	AMAZON.COM INC	AMZN UW	5,527,599.97	2.41
26	ASM PACIFIC TECHNOLO	522 HK	4,908,790.51	2.14
27	永辉超市	601933 SH	4,766,600.00	2.08

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	CTrip.COM INTERNATIONAL-ADR	CTRP UW	16,833,584.35	7.34
2	ALPHABET INC-CL A	GOOGL UW	16,805,607.66	7.33
3	BROADCOM LTD	AVGO UW	16,523,887.04	7.20

4	MOMO INC-SPON ADR	MOMO UW	12,741,320.55	5.55
5	NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	EDU US	11,433,456.26	4.98
6	INPHI CORP	IPHI US	11,330,086.80	4.94
7	大华股份	002236 SZ	11,228,431.36	4.89
8	APPLE INC	AAPL UW	9,358,911.01	4.08
9	NETEASE INC-ADR	NTES US	8,277,328.12	3.61
10	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	8,017,627.17	3.49
11	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	BABA US	6,932,221.93	3.02
12	BAIC MOTOR	1958 HK	6,617,091.13	2.88
13	AAC TECHNOLOGIES HOL	2018 HK	6,323,804.77	2.76
14	QUALCOMM INC	QCOM UW	5,931,720.78	2.59
15	PRICELINE GROUP INC/THE	PCLN UW	5,679,412.00	2.48
16	TAL EDUCATION GROUP	TAL US	5,634,407.49	2.46
17	ANALOG DEVICES INC	ADI UW	5,337,969.23	2.33
18	COHERENT INC	COHR UW	5,265,126.66	2.30
19	CHINA LODGING GROUP-SPON ADS	HTHT UW	5,023,637.65	2.19
20	MAN WAH HOLDINGS LTD	1999 HK	4,948,870.83	2.16
21	YYY INC-ADR	YY US	4,710,780.22	2.05
22	ASM PACIFIC TECHNOLO	522 HK	4,671,903.14	2.04

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	343,118,312.46
卖出收入（成交）总额	223,643,483.67

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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

7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	221,381.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	10,059.98
4	应收利息	7,989.95
5	应收申购款	1,325,501.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,564,932.83

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未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	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
8,210	23,797.80	7287032.62	3.73	188092872.46	96.27

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	455,816.03	0.2333

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	10~50
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(2017-01-25)基金份 额总额	268,156,205.81
本报告期期初基金份额总额	-
本报告期基金总申购份额	155,997,741.64
减：本报告期基金总赎回份额	228,774,042.37
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	195,379,905.08

注：总申购份额含红利再投份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 《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

<p>本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。</p> <p>本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。</p>
--

10.4 基金投资策略的改变

<p>本基金投资策略未发生改变。</p>

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2017年1月25日）起至本报告期末，为本基金进行审计。</p>

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

<p>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。</p> <p>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。</p>

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	-	133,652,704.07	23.58%	128,773.86	43.33%	-
CICCHK	-	432,729,371.27	76.35%	168,300.95	56.63%	-
CS	-	379,720.80	0.07%	123.82	0.04%	-

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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
-----	------	--------	------	------

称	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方证券	-	-%	154,800,000	100%	-	-%	-	-%
CICCHK	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%
CS	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%

- 注：（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，基金会会计负责协助及时催缴。
- （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。

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	2017-01-03
2	关于汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金增加代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-01-07
3	关于汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金增加富滇银行为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-01-12
4	关于汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金参与国联证券开展的认购费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-01-14
5	关于汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金增加交通银行为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-01-17

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	2017-01-19
7	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生效公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-01-26
8	汇添富基金管理股份有限公司关于增聘基金经理的公告(全球移动互联)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-02-04
9	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	2017-03-10
10	关于汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-03-28
11	关于汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金 2017 年境外市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-03-28
12	关于汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金参加部分代销机构定投基金、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	2017-03-28
13	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	2017-03-30
14	关于汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金参与交通银行申购、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	2017-04-11
15	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	2017-04-14
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加海通证券开展的申购、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	2017-04-22
17	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	2017-04-22

18	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	2017-04-24
19	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	2017-04-26
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中银国际证券为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017-05-03
21	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	2017-05-05

§ 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全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
- 2、《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》;
- 3、《汇添富全球移动互联灵活配置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、 报告期内汇添富全球移动互联灵活配置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 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08月26日