

汇添富上证综合指数证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 25 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 2018 年 8 月 23 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 2018 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.....	15
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.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
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.....	60
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.....	60
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.....	60
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.....	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.12 投资组合报告附注.....	60
§8 基金份额持有人信息.....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
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.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	69
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
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.....	71

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

§ 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	1,558,832,862.46 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%，以实现对标指数的有效跟踪。
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	010-66105798
	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	010-66105799
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686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19-22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19-22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19-22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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	31,718,997.70
本期利润	-163,741,177.99
加权平均基金份额本期利润	-0.1136
本期加权平均净值利润率	-10.88%
本期基金份额净值增长率	-11.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-79,754,287.95
期末可供分配基金份额利润	-0.0512
期末基金资产净值	1,479,078,574.51
期末基金份额净值	0.949
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	7.22%

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损益。

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	-6.32%	1.03%	-7.61%	1.11%	1.29%	-0.08%
过去三个月	-8.13%	0.95%	-9.63%	1.00%	1.50%	-0.05%
过去六个月	-11.45%	0.99%	-13.20%	1.03%	1.75%	-0.04%
过去一年	-6.48%	0.79%	-10.25%	0.81%	3.77%	-0.02%
过去三年	-24.66%	1.43%	-31.70%	1.39%	7.04%	0.04%
自基金合同生效日起至今	7.22%	1.37%	-3.42%	1.34%	10.64%	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：本基金建仓期为本《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 2018 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 4213.15 亿元，有效客户数约 1988 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 110 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、汇添富添福吉祥混合型证券投资基金、汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金、汇添富盈润混合型证券投资基金、汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富民丰回报混合型证券投资基金、汇添富睿丰混合型证券投资基金、汇添富弘安混合型证券投资基金、汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金、汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）、上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金、汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金、汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金、汇添富行业整合主题混合型证券投资基金、汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金、汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富智能制造股票型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富文体

娱乐主题混合型证券投资基金。

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、汇添富主要消费 ETF 联接基金、汇添富中证精准医药指数基金、中证上海国企 ETF、汇添富中证互联网医疗指数（LOF）、汇添富中证 500 指数（LOF）、添富价值多因子股票的基金经理，指数与量化投资部副总监。	2010 年 2 月 5 日	-	12 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，2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数 (LOF) 的基金经理，2018 年 3 月 23 日至今任添富价值多因子股票的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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 4 次，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 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

回顾 2018 年上半年，基本上，经济保持韧性，企业盈利整体向好，贸易维持较高景气度，出口转好。于此同时，金融监管保持定力，流动性结构性偏紧。市场涨跌的主要影响因素包括：上市公司业绩、中美贸易摩擦的反复和大国博弈深化、去杠杆伴随的资金面收紧及信用风险暴露、汇率波动影响海外投资者对人民币资产的风险偏好。

风格上，市值角度，中小市值公司受宏观流动性影响相对较大，财务不确定性高，下跌幅度整体更大；基本面角度，在去杠杆和强监管背景下，财务质地优良、杠杆率合理、盈利能力强、现金流充裕、增长确定性高、基本面与估值匹配度较好的高质量公司具有一定超额收益。

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 90%~95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

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 0.949 元；本报告期基金份额净值增长率为-11.45%，业绩比较基准收益率为-13.20%。

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，中美贸易摩擦以及国内去杠杆的节奏和力度仍是影响市场的主要变量，在此背景下，内需的韧性和经济结构转型的进度可能成为市场的关注点。当前 A 股整体估值水平处于历

史低位，较为充分地反应了市场预期，具备长期投资价值。长期看，贸易争端和去杠杆均是产业升级过程中的必经之路。随着国内经济结构的逐步调整、潜在金融风险的逐步化解、市场透明度的逐步提升，积极因素将逐渐显现，从而改善整体风险偏好，带来新的热点和投资机会。

风格上，A 股有进一步向成熟市场靠拢的可能性，基本面质地优良的股票仍具有核心配置价值。在众多外部变量作用下，风格和行业的切换可能更为频繁。随着市场的逐步企稳，市场关注点很可能从安全性转向长期的成长性上。

作为指数基金，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，实现有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

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。

本基金于 2018 年 1 月 18 日实施利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.180 元人民币。

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对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 19,313,624.90 元。

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上证综合指数证券投资基金 2018 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	115,651,524.18	65,661,717.87
结算备付金		-	-
存出保证金		215,287.51	88,976.35
交易性金融资产	6.4.7.2	1,362,971,376.20	1,187,810,854.34
其中：股票投资		1,362,746,505.60	1,187,250,096.24
基金投资		-	-
债券投资		224,870.60	560,758.10
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	21,239.63	13,545.35
应收股利		-	-
应收申购款		2,251,768.83	324,435.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,481,111,196.35	1,253,899,529.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		604,462.90	918,856.42
应付管理人报酬		947,535.27	797,405.31
应付托管费		189,507.07	159,481.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	991.12	127,826.15

应交税费		0.67	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	290,124.81	380,466.79
负债合计		2,032,621.84	2,384,035.74
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,558,832,862.46	1,148,960,948.31
未分配利润	6.4.7.10	-79,754,287.95	102,554,545.44
所有者权益合计		1,479,078,574.51	1,251,515,493.75
负债和所有者权益总计		1,481,111,196.35	1,253,899,529.49

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.949 元，基金份额总额 1,558,832,862.46 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-155,721,656.74	88,038,125.46
1.利息收入		391,843.40	327,508.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	391,506.28	327,326.83
债券利息收入		337.12	181.81
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）		39,052,326.39	11,844,292.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	20,662,716.71	29,214.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	66,935.06	50,913.69
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	18,322,674.62	11,764,164.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-195,460,175.69	75,722,597.07
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	294,349.16	143,727.18
减：二、费用		8,019,521.25	6,673,628.18
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,625,849.46	5,282,686.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,125,169.94	1,056,537.38
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,070,887.92	136,834.84
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.64	-
7. 其他费用	6.4.7.20	197,613.29	197,569.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-163,741,177.99	81,364,497.28

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	1,148,960,948.31	102,554,545.44	1,251,515,493.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-163,741,177.99	-163,741,177.99
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）	409,871,914.15	745,969.50	410,617,883.65
其中：1.基金申购款	762,169,083.15	25,915,030.82	788,084,113.97
2.基金赎回款	-352,297,169.00	-25,169,061.32	-377,466,230.32
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）	-	-19,313,624.90	-19,313,624.90
五、期末所有者权益（基金净值）	1,558,832,862.46	-79,754,287.95	1,479,078,574.51

项目	上年度可比期间 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

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（以下统称“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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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 增值税

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、地方政府债券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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债

券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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[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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	115,651,524.18
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	115,651,524.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,460,589,450.06	1,362,746,505.60	-97,842,944.46
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	224,870.60	-8,129.40
	银行间市场	-	-
	合计	224,870.60	-8,129.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,460,822,450.06	1,362,971,376.20	-97,851,073.86

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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 2018年6月30日
应收活期存款利息	20,990.23
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	162.19
应收资产支持证券利息	-
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	87.21
合计	21,239.63

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	991.12
银行间市场应付交易费用	-
合计	991.12

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,687.52
应付信息披露费	248,765.71

应付审计费	39,671.58
合计	290,124.81

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,148,960,948.31	1,148,960,948.31
本期申购	762,169,083.15	762,169,083.15
本期赎回(以“-”号填列)	-352,297,169.00	-352,297,169.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,558,832,862.46	1,558,832,862.46

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	375,293,605.27	-272,739,059.83	102,554,545.44
本期利润	31,718,997.70	-195,460,175.69	-163,741,177.99
本期基金份额交易产生的变动数	131,363,158.35	-130,617,188.85	745,969.50
其中：基金申购款	246,178,259.79	-220,263,228.97	25,915,030.82
基金赎回款	-114,815,101.44	89,646,040.12	-25,169,061.32
本期已分配利润	-19,313,624.90	-	-19,313,624.90
本期末	519,062,136.42	-598,816,424.37	-79,754,287.95

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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	11,284.57

其他	14,748.19
合计	391,506.28

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
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	235,069,967.62
减：卖出股票成本总额	214,407,250.91
买卖股票差价收入	20,662,716.71

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	922,251.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	855,000.00
减：应收利息总额	316.64
买卖债券差价收入	66,935.06

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	18,322,674.62

基金投资产生的股利收益	-
合计	18,322,674.62

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-195,460,175.69
——股票投资	-195,414,288.19
——债券投资	-45,887.50
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-195,460,175.69

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	294,349.16
合计	294,349.16

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,070,887.92
银行间市场交易费用	-
合计	1,070,887.92

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
账户维护费	9,000.00
银行划款费	176.00
合计	197,613.29

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：以下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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	532,154,870.43	64.94%	67,734,970.18	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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	922,251.70	100.00%	1,710,095.50	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2018年1月1日至2018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	495,598.92	64.94%	991.12	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,625,849.46	5,282,686.67
其中：支付销售机构的客户维护费	883,642.46	1,077,078.01

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,125,169.94	1,056,537.38

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：本报告期末和上年度可比期末除基金管理人之外的其它关联方均未有投资本基金的情况。

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	115,651,524.18	365,473.52	77,403,379.56	325,682.43

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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2018年1月18日	-	2018年1月18日	0.180	10,502,847.91	8,810,776.99	19,313,624.90	
合计	-	-	-	0.180	10,502,847.91	8,810,776.99	19,313,624.90	

6.4.12 期末（2018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
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

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
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大资产重组停牌	7.47	2018年8月20日	7.25	931,628	7,597,598.68	6,959,261.16	-
601727	上海电气	2018年6月6日	重大资产重组停牌	6.34	2018年8月7日	5.71	525,792	4,278,911.72	3,333,521.28	-
600745	闻泰科技	2018年4月17日	重大资产重组停牌	30.48	-	-	67,200	1,744,518.63	2,048,256.00	-

600221	海航控股	2018年1月10日	重大资产重组停牌	3.23	2018年7月20日	2.91	618,860	2,000,813.19	1,998,917.80	-
600515	海航基础	2018年1月23日	重大资产重组停牌	11.16	2018年8月13日	10.04	141,974	1,853,749.86	1,584,429.84	-
600641	万业企业	2018年4月17日	重大资产重组停牌	12.18	2018年8月9日	10.96	125,800	1,577,950.91	1,532,244.00	-
600850	华东电脑	2018年5月14日	重大资产重组停牌	18.99	2018年8月15日	18.00	77,300	1,447,579.98	1,467,927.00	-
600811	东方集团	2018年5月30日	重大事项停牌	4.30	-	-	320,952	1,775,976.71	1,380,093.60	-
601118	海南橡胶	2018年5月24日	重大资产重组	6.62	-	-	207,487	1,659,053.03	1,373,563.94	-

			组 停 牌							
600750	江中 药业	2018 年 5 月 2 日	重 大 资 产 重 组 停 牌	17.75	2018 年 8 月 1 日	16.12	75,882	1,494,994.51	1,346,905.50	-
600485	信威 集团	2016 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	-
600751	海航 科技	2018 年 1 月 12 日	重 大 资 产 重 组 停 牌	6.49	-	-	188,075	1,160,766.53	1,220,606.75	-
600848	上海 临港	2018 年 6 月 15 日	重 大 资 产 重 组 停 牌	21.67	-	-	54,800	1,251,132.24	1,187,516.00	-
600022	山东 钢铁	2018 年 3 月 27 日	重 大 资 产 重 组 停 牌	2.02	2018 年 8 月 16 日	1.83	569,518	1,406,970.58	1,150,426.36	-
600796	钱江	2018	重	6.08	-	-	180,982	1,407,962.77	1,100,370.56	-

	生化	年 5 月 2 日	大资产重组停牌								
600896	*ST 海投	2018 年 5 月 7 日	重大资产重组停牌	5.12	2018 年 7 月 13 日	4.86	190,191	1,403,193.73	973,777.92	-	
600293	三峡新材	2018 年 5 月 2 日	重大事项停牌	5.68	2018 年 8 月 7 日	5.11	168,400	1,486,924.61	956,512.00	-	
600784	鲁银投资	2018 年 1 月 11 日	重大资产重组停牌	5.46	2018 年 7 月 9 日	5.24	173,200	1,140,853.34	945,672.00	-	
600122	宏图高科	2018 年 6 月 19 日	重大资产重组停牌	7.40	-	-	104,300	1,059,018.75	771,820.00	-	
600687	刚泰控股	2018 年 6 月 11 日	重大资产重组停	9.09	2018 年 8 月 20 日	8.18	81,600	1,042,604.56	741,744.00	-	

600175	美都能源	2018年5月30日	牌重大资产重组停牌	4.16	2018年8月17日	3.74	4,973	22,348.01	20,687.68	-
--------	------	------------	-----------	------	------------	------	-------	-----------	-----------	---

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

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券均在证券交易所上市；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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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、债券投资、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 2018 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	115,651,524.18	-	-	-	-	-	115,651,524.18
存出保证金	215,287.51	-	-	-	-	-	215,287.51
交易性金融资 产	-	-	-224,870.60	-	-	-1,362,746,505.60	-1,362,971,376.20
应收利息	-	-	-	-	-	21,239.63	21,239.63
应收申购款	671,747.79	-	-	-	-	1,580,021.04	2,251,768.83
资产总计	116,538,559.48	-	-224,870.60	-	-	-1,364,347,766.27	1,481,111,196.35
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	604,462.90	604,462.90
应付管理人报 酬	-	-	-	-	-	947,535.27	947,535.27
应付托管费	-	-	-	-	-	189,507.07	189,507.07
应付交易费用	-	-	-	-	-	991.12	991.12
应交税费	-	-	-	-	-	0.67	0.67
其他负债	-	-	-	-	-	290,124.81	290,124.81
负债总计	-	-	-	-	-	2,032,621.84	2,032,621.84
利率敏感度缺 口	116,538,559.48	-	-224,870.60	-	-	-1,362,315,144.43	1,479,078,574.51
上年度末 2017 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	65,661,717.87	-	-	-	-	-	65,661,717.87
存出保证金	88,976.35	-	-	-	-	-	88,976.35
交易性金融资 产	-	-	-560,758.10	-	-	-1,187,250,096.24	-1,187,810,854.34
应收利息	-	-	-	-	-	13,545.35	13,545.35
应收申购款	101,039.50	-	-	-	-	223,396.08	324,435.58
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	65,851,733.72	-	-560,758.10	-	-	-1,187,487,037.67	1,253,899,529.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	918,856.42	918,856.42
应付管理人报 酬	-	-	-	-	-	797,405.31	797,405.31
应付托管费	-	-	-	-	-	159,481.07	159,481.07
应付交易费用	-	-	-	-	-	127,826.15	127,826.15
其他负债	-	-	-	-	-	380,466.79	380,466.79
负债总计	-	-	-	-	-	2,384,035.74	2,384,035.74
利率敏感度缺	65,851,733.72	-	-560,758.10	-	-	-1,185,103,001.93	1,251,515,493.75

口							
---	--	--	--	--	--	--	--

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：本基金本报告期末及上年度末计息资产仅包括银行存款、存出保证金及部分应收申购款，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及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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 2018年6月30日		上年度末 2017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	1,362,746,505.60	92.13	1,187,250,096.24	94.87
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	224,870.60	0.02	560,758.10	0.04
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	1,362,971,376.20	92.15	1,187,810,854.34	94.91

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%；投资于标的指数成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%。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。

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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	上证综合指数上涨 5%	67,746,600.24	56,057,565.76
	上证综合指数下跌 5%	-67,746,600.24	-56,057,565.76

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	1,362,746,505.60	92.01
	其中：股票	1,362,746,505.60	92.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	224,870.60	0.02
	其中：债券	224,870.60	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	115,651,524.18	7.81
8	其他各项资产	2,488,295.97	0.17
9	合计	1,481,111,196.35	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	2,567,334.34	0.17
B	采矿业	153,789,648.56	10.40
C	制造业	454,313,319.85	30.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	61,127,451.38	4.13
E	建筑业	49,356,315.28	3.34
F	批发和零售业	44,932,672.24	3.04
G	交通运输、仓储和邮政业	66,493,816.24	4.50
H	住宿和餐饮业	4,545,206.86	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,927,435.78	1.41
J	金融业	413,632,678.30	27.97
K	房地产业	49,835,516.09	3.37
L	租赁和商务服务业	12,807,085.10	0.87

M	科学研究和技术服务业	3,137,521.93	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	2,659,855.74	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	973,777.92	0.07
R	文化、体育和娱乐业	15,684,423.49	1.06
S	综合	5,622,322.99	0.38
	合计	1,362,406,382.09	92.11

7.2.2 期末积极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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	67,459.26	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	201,104.40	0.01
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	340,123.51	0.02

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持有港股通股票投资。

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	18,769,106	64,565,724.64	4.37
2	601857	中国石油	7,959,157	61,365,100.47	4.15
3	601988	中国银行	14,299,911	51,622,678.71	3.49
4	600519	贵州茅台	64,477	47,162,346.42	3.19
5	600036	招商银行	1,648,715	43,592,024.60	2.95
6	601318	中国平安	533,190	31,234,270.20	2.11
7	600028	中国石化	4,700,177	30,504,148.73	2.06
8	601328	交通银行	4,488,617	25,764,661.58	1.74
9	601628	中国人寿	1,028,271	23,156,662.92	1.57
10	600104	上汽集团	576,199	20,161,203.01	1.36
11	601939	建设银行	2,782,611	18,226,102.05	1.23
12	600900	长江电力	1,080,358	17,436,978.12	1.18
13	601088	中国神华	813,715	16,225,477.10	1.10
14	601166	兴业银行	1,025,835	14,772,024.00	1.00
15	600276	恒瑞医药	184,690	13,992,114.40	0.95
16	600000	浦发银行	1,386,092	13,251,039.52	0.90
17	601668	中国建筑	2,088,585	11,403,674.10	0.77
18	601998	中信银行	1,703,972	10,581,666.12	0.72
19	600016	民生银行	1,470,090	10,290,630.00	0.70
20	601601	中国太保	317,578	10,114,859.30	0.68
21	603288	海天味业	136,975	10,086,839.00	0.68
22	601766	中国中车	1,210,961	9,324,399.70	0.63
23	601225	陕西煤业	1,094,209	8,994,397.98	0.61
24	600019	宝钢股份	1,106,055	8,616,168.45	0.58
25	600887	伊利股份	305,752	8,530,480.80	0.58
26	600030	中信证券	491,600	8,145,812.00	0.55
27	601818	光大银行	1,989,567	7,281,815.22	0.49
28	600048	保利地产	594,868	7,257,389.60	0.49
29	601390	中国中铁	931,628	6,959,261.16	0.47
30	601688	华泰证券	464,760	6,957,457.20	0.47
31	600018	上港集团	1,159,279	6,909,302.84	0.47
32	600585	海螺水泥	200,881	6,725,495.88	0.45
33	601800	中国交建	588,039	6,697,764.21	0.45

34	601888	中国国旅	102,384	6,594,553.44	0.45
35	600050	中国联通	1,253,201	6,165,748.92	0.42
36	601229	上海银行	389,018	6,130,923.68	0.41
37	601006	大秦铁路	742,844	6,098,749.24	0.41
38	600690	青岛海尔	316,600	6,097,716.00	0.41
39	600518	康美药业	248,863	5,693,985.44	0.38
40	600009	上海机场	101,936	5,655,409.28	0.38
41	601211	国泰君安	375,900	5,540,766.00	0.37
42	603993	洛阳钼业	880,339	5,537,332.31	0.37
43	601169	北京银行	911,872	5,498,588.16	0.37
44	600031	三一重工	608,107	5,454,719.79	0.37
45	600188	兖州煤业	410,683	5,355,306.32	0.36
46	601186	中国铁建	575,259	4,958,732.58	0.34
47	600516	方大炭素	201,503	4,912,643.14	0.33
48	601117	中国化学	718,527	4,835,686.71	0.33
49	600015	华夏银行	641,781	4,781,268.45	0.32
50	600309	万华化学	104,811	4,760,515.62	0.32
51	601336	新华保险	107,255	4,599,094.40	0.31
52	600271	航天信息	177,824	4,493,612.48	0.30
53	601111	中国国航	501,581	4,459,055.09	0.30
54	601985	中国核电	777,900	4,395,135.00	0.30
55	601989	中国重工	1,058,129	4,274,841.16	0.29
56	600196	复星医药	102,491	4,242,102.49	0.29
57	601669	中国电建	766,583	4,108,884.88	0.28
58	600606	绿地控股	610,288	3,991,283.52	0.27
59	600703	三安光电	206,354	3,966,123.88	0.27
60	600999	招商证券	286,197	3,915,174.96	0.26
61	600436	片仔癀	34,838	3,899,417.34	0.26
62	600340	华夏幸福	150,136	3,866,002.00	0.26
63	600837	海通证券	405,786	3,842,793.42	0.26
64	601238	广汽集团	342,656	3,817,187.84	0.26
65	600741	华域汽车	159,150	3,775,038.00	0.26
66	600153	建发股份	416,495	3,744,290.05	0.25
67	600919	江苏银行	579,900	3,717,159.00	0.25
68	601155	新城控股	119,400	3,697,818.00	0.25
69	601933	永辉超市	475,701	3,634,355.64	0.25
70	600089	特变电工	514,719	3,567,002.67	0.24
71	600010	包钢股份	2,269,782	3,518,162.10	0.24
72	600011	华能国际	526,596	3,349,150.56	0.23

73	601727	上海电气	525,792	3,333,521.28	0.23
74	603799	华友钴业	33,803	3,294,778.41	0.22
75	600115	东方航空	493,826	3,269,128.12	0.22
76	601009	南京银行	422,676	3,267,285.48	0.22
77	600023	浙能电力	680,979	3,173,362.14	0.21
78	600549	厦门钨业	209,001	3,172,635.18	0.21
79	601633	长城汽车	317,925	3,122,023.50	0.21
80	601899	紫金矿业	863,242	3,116,303.62	0.21
81	600332	白云山	81,865	3,114,963.25	0.21
82	600809	山西汾酒	49,526	3,114,690.14	0.21
83	603833	欧派家居	24,203	3,086,608.59	0.21
84	600398	海澜之家	236,195	3,009,124.30	0.20
85	600029	南方航空	351,841	2,973,056.45	0.20
86	601618	中国中冶	890,759	2,966,227.47	0.20
87	600967	内蒙一机	227,482	2,898,120.68	0.20
88	600810	神马股份	190,864	2,836,239.04	0.19
89	601018	宁波港	658,374	2,771,754.54	0.19
90	601901	方正证券	411,400	2,752,266.00	0.19
91	600660	福耀玻璃	106,330	2,733,744.30	0.18
92	601881	中国银河	325,304	2,644,721.52	0.18
93	600183	生益科技	284,853	2,609,253.48	0.18
94	600085	同仁堂	73,954	2,609,097.12	0.18
95	601877	正泰电器	113,862	2,541,399.84	0.17
96	600795	国电电力	968,628	2,537,805.36	0.17
97	600886	国投电力	348,805	2,535,812.35	0.17
98	600511	国药股份	93,920	2,531,144.00	0.17
99	600588	用友网络	103,210	2,529,677.10	0.17
100	600867	通化东宝	105,412	2,526,725.64	0.17
101	601100	恒立液压	120,935	2,525,122.80	0.17
102	601012	隆基股份	149,089	2,488,295.41	0.17
103	600260	凯乐科技	92,300	2,477,332.00	0.17
104	601098	中南传媒	193,856	2,450,339.84	0.17
105	601607	上海医药	101,997	2,437,728.30	0.16
106	600383	金地集团	238,431	2,429,611.89	0.16
107	600201	生物股份	140,946	2,408,767.14	0.16
108	600161	天坛生物	123,837	2,396,245.95	0.16
109	600487	亨通光电	104,579	2,305,966.95	0.16
110	600297	广汇汽车	393,301	2,304,743.86	0.16
111	600893	航发动力	103,252	2,304,584.64	0.16

112	600098	广州发展	350,957	2,263,672.65	0.15
113	600547	山东黄金	93,419	2,234,582.48	0.15
114	600705	中航资本	472,056	2,204,501.52	0.15
115	601898	中煤能源	453,387	2,189,859.21	0.15
116	600282	南钢股份	495,400	2,189,668.00	0.15
117	600535	天士力	84,630	2,185,146.60	0.15
118	600346	恒力股份	148,921	2,183,181.86	0.15
119	600688	上海石化	383,194	2,180,373.86	0.15
120	600111	北方稀土	190,887	2,172,294.06	0.15
121	601788	光大证券	197,538	2,168,967.24	0.15
122	600637	东方明珠	143,230	2,157,043.80	0.15
123	600566	济川药业	44,700	2,154,093.00	0.15
124	600926	杭州银行	192,700	2,137,043.00	0.14
125	600066	宇通客车	111,199	2,133,908.81	0.14
126	600816	安信信托	287,002	2,077,894.48	0.14
127	601231	环旭电子	227,478	2,063,225.46	0.14
128	600350	山东高速	507,837	2,056,739.85	0.14
129	600745	闻泰科技	67,200	2,048,256.00	0.14
130	600663	陆家嘴	129,235	2,040,620.65	0.14
131	600406	国电南瑞	128,902	2,036,651.60	0.14
132	600352	浙江龙盛	170,322	2,035,347.90	0.14
133	600062	华润双鹤	82,511	2,025,645.05	0.14
134	601866	中远海发	803,692	2,001,193.08	0.14
135	600221	海航控股	618,860	1,998,917.80	0.14
136	601919	中远海控	395,729	1,946,986.68	0.13
137	600559	老白干酒	96,888	1,936,791.12	0.13
138	600674	川投能源	220,000	1,918,400.00	0.13
139	600649	城投控股	312,025	1,909,593.00	0.13
140	600176	中国巨石	186,126	1,904,068.98	0.13
141	601228	广州港	327,075	1,900,305.75	0.13
142	601198	东兴证券	145,397	1,895,976.88	0.13
143	600323	瀚蓝环境	123,792	1,884,114.24	0.13
144	600233	圆通速递	142,200	1,877,040.00	0.13
145	603008	喜临门	94,800	1,875,144.00	0.13
146	600529	山东药玻	76,398	1,858,763.34	0.13
147	603338	浙江鼎力	39,627	1,838,692.80	0.12
148	600521	华海药业	68,400	1,825,596.00	0.12
149	603589	口子窖	29,600	1,818,920.00	0.12
150	600203	福日电子	183,400	1,813,826.00	0.12

151	600377	宁沪高速	199,310	1,809,734.80	0.12
152	600362	江西铜业	111,532	1,767,782.20	0.12
153	600570	恒生电子	33,260	1,761,117.00	0.12
154	601600	中国铝业	457,765	1,757,817.60	0.12
155	600068	葛洲坝	243,019	1,752,166.99	0.12
156	600600	青岛啤酒	39,955	1,751,227.65	0.12
157	601377	兴业证券	332,106	1,750,198.62	0.12
158	600236	桂冠电力	305,098	1,742,109.58	0.12
159	600208	新湖中宝	449,610	1,717,510.20	0.12
160	600061	国投资本	184,403	1,711,259.84	0.12
161	603160	汇顶科技	26,203	1,700,312.67	0.11
162	600027	华电国际	426,275	1,670,998.00	0.11
163	600461	洪城水业	263,000	1,651,640.00	0.11
164	600299	安迪苏	141,100	1,642,404.00	0.11
165	600835	上海机电	86,863	1,638,236.18	0.11
166	600482	中国动力	92,700	1,617,615.00	0.11
167	600409	三友化工	186,426	1,605,127.86	0.11
168	601991	大唐发电	524,941	1,590,571.23	0.11
169	600515	海航基础	141,974	1,584,429.84	0.11
170	600977	中国电影	98,500	1,579,940.00	0.11
171	600754	锦江股份	42,472	1,569,765.12	0.11
172	603816	顾家家居	21,300	1,565,763.00	0.11
173	601678	滨化股份	252,214	1,558,682.52	0.11
174	601021	春秋航空	44,301	1,551,864.03	0.10
175	601212	白银有色	378,600	1,548,474.00	0.10
176	600315	上海家化	39,000	1,545,570.00	0.10
177	600593	大连圣亚	62,020	1,543,057.60	0.10
178	600641	万业企业	125,800	1,532,244.00	0.10
179	601339	百隆东方	266,200	1,530,650.00	0.10
180	600390	五矿资本	197,100	1,527,525.00	0.10
181	603898	好莱客	58,000	1,521,920.00	0.10
182	601997	贵阳银行	122,800	1,517,808.00	0.10
183	603025	大豪科技	78,421	1,516,662.14	0.10
184	600258	首旅酒店	55,722	1,513,966.74	0.10
185	600612	老凤祥	42,102	1,513,145.88	0.10
186	600729	重庆百货	45,674	1,504,958.30	0.10
187	601808	中海油服	156,997	1,497,751.38	0.10
188	601699	潞安环能	160,702	1,488,100.52	0.10
189	600998	九州通	87,683	1,487,103.68	0.10

190	600479	千金药业	141,240	1,481,607.60	0.10
191	600850	华东电脑	77,300	1,467,927.00	0.10
192	600351	亚宝药业	202,191	1,467,906.66	0.10
193	600694	大商股份	45,022	1,463,665.22	0.10
194	601007	金陵饭店	132,500	1,461,475.00	0.10
195	600177	雅戈尔	188,022	1,447,769.40	0.10
196	600256	广汇能源	353,846	1,447,230.14	0.10
197	600438	通威股份	207,385	1,430,956.50	0.10
198	601992	金隅集团	436,062	1,430,283.36	0.10
199	601878	浙商证券	169,498	1,423,783.20	0.10
200	600057	厦门象屿	284,983	1,422,065.17	0.10
201	600270	外运发展	67,700	1,418,992.00	0.10
202	600498	烽火通信	56,915	1,414,337.75	0.10
203	603989	艾华集团	62,661	1,407,992.67	0.10
204	603788	宁波高发	57,123	1,407,510.72	0.10
205	600170	上海建工	459,951	1,398,251.04	0.09
206	600839	四川长虹	488,093	1,395,945.98	0.09
207	600004	白云机场	106,305	1,391,532.45	0.09
208	601636	旗滨集团	312,400	1,390,180.00	0.09
209	600522	中天科技	156,773	1,381,170.13	0.09
210	600811	东方集团	320,952	1,380,093.60	0.09
211	601118	海南橡胶	207,487	1,373,563.94	0.09
212	600410	华胜天成	156,300	1,367,625.00	0.09
213	600345	长江通信	49,800	1,365,018.00	0.09
214	600884	杉杉股份	61,693	1,363,415.30	0.09
215	600229	城市传媒	168,600	1,362,288.00	0.09
216	603393	新天然气	39,801	1,348,457.88	0.09
217	600750	江中药业	75,882	1,346,905.50	0.09
218	600114	东睦股份	137,788	1,346,188.76	0.09
219	600597	光明乳业	136,296	1,345,241.52	0.09
220	600038	中直股份	33,604	1,343,823.96	0.09
221	603515	欧普照明	28,601	1,336,810.74	0.09
222	600093	易见股份	132,500	1,335,600.00	0.09
223	600699	均胜电子	51,900	1,333,311.00	0.09
224	603167	渤海轮渡	138,404	1,332,830.52	0.09
225	603606	东方电缆	178,340	1,326,849.60	0.09
226	603599	广信股份	92,000	1,321,120.00	0.09
227	600708	光明地产	305,760	1,314,768.00	0.09
228	600219	南山铝业	484,930	1,314,160.30	0.09

229	600339	中油工程	291,500	1,308,835.00	0.09
230	600633	浙数文化	156,396	1,304,342.64	0.09
231	600168	武汉控股	201,900	1,304,274.00	0.09
232	601158	重庆水务	239,164	1,296,268.88	0.09
233	601579	会稽山	132,300	1,295,217.00	0.09
234	600064	南京高科	175,840	1,290,665.60	0.09
235	600976	健民集团	61,400	1,288,786.00	0.09
236	600080	金花股份	130,994	1,287,671.02	0.09
237	600497	驰宏锌锗	235,885	1,285,573.25	0.09
238	601127	小康股份	74,000	1,279,460.00	0.09
239	600510	黑牡丹	210,681	1,276,726.86	0.09
240	600485	信威集团	87,151	1,271,533.09	0.09
241	603919	金徽酒	76,800	1,269,504.00	0.09
242	600885	宏发股份	42,281	1,265,047.52	0.09
243	601333	广深铁路	296,751	1,261,191.75	0.09
244	600675	中华企业	255,996	1,256,940.36	0.08
245	601900	南方传媒	132,597	1,251,715.68	0.08
246	600448	华纺股份	253,400	1,244,194.00	0.08
247	600273	嘉化能源	137,300	1,243,938.00	0.08
248	600584	长电科技	73,371	1,242,904.74	0.08
249	600489	中金黄金	182,143	1,242,215.26	0.08
250	600987	航民股份	131,400	1,241,730.00	0.08
251	600118	中国卫星	64,905	1,239,685.50	0.08
252	600739	辽宁成大	81,648	1,239,416.64	0.08
253	600577	精达股份	356,060	1,235,528.20	0.08
254	600858	银座股份	190,500	1,234,440.00	0.08
255	601677	明泰铝业	122,198	1,226,867.92	0.08
256	600697	欧亚集团	57,600	1,226,304.00	0.08
257	603818	曲美家居	104,096	1,224,168.96	0.08
258	600751	海航科技	188,075	1,220,606.75	0.08
259	600583	海油工程	231,620	1,218,321.20	0.08
260	600372	中航电子	92,909	1,213,391.54	0.08
261	601199	江南水务	276,994	1,213,233.72	0.08
262	603508	思维列控	35,602	1,209,399.94	0.08
263	600665	天地源	339,493	1,205,200.15	0.08
264	603018	中设集团	75,924	1,202,636.16	0.08
265	601518	吉林高速	405,756	1,201,037.76	0.08
266	600528	中铁工业	117,308	1,198,887.76	0.08
267	600240	华业资本	163,400	1,197,722.00	0.08

268	600986	科达股份	127,900	1,197,144.00	0.08
269	600642	申能股份	238,180	1,195,663.60	0.08
270	603306	华懋科技	70,005	1,193,585.25	0.08
271	603726	朗迪集团	63,839	1,193,150.91	0.08
272	603663	三祥新材	66,500	1,191,680.00	0.08
273	600392	盛和资源	73,303	1,189,707.69	0.08
274	600488	天药股份	289,300	1,189,023.00	0.08
275	600848	上海临港	54,800	1,187,516.00	0.08
276	603779	威龙股份	80,800	1,186,952.00	0.08
277	600327	大东方	241,016	1,185,798.72	0.08
278	600704	物产中大	226,292	1,183,507.16	0.08
279	600790	轻纺城	329,980	1,181,328.40	0.08
280	600415	小商品城	273,673	1,179,530.63	0.08
281	600308	华泰股份	236,625	1,178,392.50	0.08
282	600180	瑞茂通	121,196	1,174,389.24	0.08
283	600757	长江传媒	206,207	1,173,317.83	0.08
284	600325	华发股份	149,962	1,159,206.26	0.08
285	603979	金诚信	135,300	1,154,109.00	0.08
286	600020	中原高速	305,901	1,153,246.77	0.08
287	601599	鹿港文化	283,123	1,152,310.61	0.08
288	600382	广东明珠	109,100	1,151,005.00	0.08
289	600022	山东钢铁	569,518	1,150,426.36	0.08
290	600400	红豆股份	305,760	1,146,600.00	0.08
291	603077	和邦生物	660,655	1,142,933.15	0.08
292	600283	钱江水利	105,100	1,141,386.00	0.08
293	603100	川仪股份	134,978	1,140,564.10	0.08
294	600369	西南证券	295,878	1,139,130.30	0.08
295	600452	涪陵电力	41,699	1,138,799.69	0.08
296	600361	华联综超	272,289	1,135,445.13	0.08
297	600375	华菱星马	228,100	1,133,657.00	0.08
298	601107	四川成渝	330,225	1,132,671.75	0.08
299	600109	国金证券	159,170	1,131,698.70	0.08
300	601216	君正集团	335,650	1,131,140.50	0.08
301	600618	氯碱化工	132,800	1,130,128.00	0.08
302	600971	恒源煤电	158,155	1,129,226.70	0.08
303	600088	中视传媒	119,272	1,128,313.12	0.08
304	600808	马钢股份	314,130	1,127,726.70	0.08
305	600873	梅花生物	269,531	1,126,639.58	0.08
306	600673	东阳光科	108,852	1,124,441.16	0.08

307	600368	五洲交通	350,460	1,121,472.00	0.08
308	600658	电子城	213,364	1,115,893.72	0.08
309	601188	龙江交通	339,000	1,111,920.00	0.08
310	600909	华安证券	192,900	1,103,388.00	0.07
311	603159	上海亚虹	53,100	1,102,887.00	0.07
312	600796	钱江生化	180,982	1,100,370.56	0.07
313	600348	阳泉煤业	153,607	1,098,290.05	0.07
314	600825	新华传媒	263,778	1,097,316.48	0.07
315	600578	京能电力	351,011	1,095,154.32	0.07
316	600594	益佰制药	122,000	1,093,120.00	0.07
317	601137	博威合金	135,200	1,092,416.00	0.07
318	600713	南京医药	223,296	1,091,917.44	0.07
319	601611	中国核建	137,900	1,089,410.00	0.07
320	601555	东吴证券	158,892	1,085,232.36	0.07
321	600668	尖峰集团	88,900	1,084,580.00	0.07
322	600073	上海梅林	162,800	1,080,992.00	0.07
323	600527	江南高纤	416,804	1,075,354.32	0.07
324	600008	首创股份	254,300	1,073,146.00	0.07
325	601811	新华文轩	109,900	1,068,228.00	0.07
326	600300	维维股份	325,790	1,062,075.40	0.07
327	600160	巨化股份	144,629	1,058,684.28	0.07
328	601958	金铂股份	168,635	1,057,341.45	0.07
329	603001	奥康国际	88,700	1,056,417.00	0.07
330	600862	中航高科	171,697	1,055,936.55	0.07
331	600279	重庆港九	237,700	1,055,388.00	0.07
332	600056	中国医药	57,700	1,054,179.00	0.07
333	600336	澳柯玛	267,582	1,051,597.26	0.07
334	600966	博汇纸业	243,877	1,051,109.87	0.07
335	600628	新世界	146,285	1,050,326.30	0.07
336	601177	杭齿前进	167,980	1,049,875.00	0.07
337	600586	金晶科技	320,398	1,047,701.46	0.07
338	600978	宜华生活	152,800	1,043,624.00	0.07
339	603020	爱普股份	113,100	1,035,996.00	0.07
340	603869	北部湾旅	62,800	1,035,572.00	0.07
341	603766	隆鑫通用	189,892	1,031,113.56	0.07
342	600455	博通股份	46,905	1,029,095.70	0.07
343	600287	江苏舜天	192,500	1,027,950.00	0.07
344	600573	惠泉啤酒	157,800	1,027,278.00	0.07
345	600239	云南城投	228,250	1,024,842.50	0.07

346	600561	江西长运	168,700	1,022,322.00	0.07
347	600090	同济堂	179,390	1,020,729.10	0.07
348	600982	宁波热电	327,600	1,018,836.00	0.07
349	600676	交运股份	204,800	1,017,856.00	0.07
350	601966	玲珑轮胎	64,500	1,017,165.00	0.07
351	600243	青海华鼎	184,100	1,010,709.00	0.07
352	600879	航天电子	142,700	1,003,181.00	0.07
353	600823	世茂股份	238,980	998,936.40	0.07
354	600100	同方股份	113,422	995,845.16	0.07
355	600356	恒丰纸业	159,804	993,980.88	0.07
356	600623	华谊集团	98,800	986,024.00	0.07
357	600603	广汇物流	243,740	979,834.80	0.07
358	603225	新凤鸣	49,004	978,609.88	0.07
359	600984	建设机械	176,280	978,354.00	0.07
360	600167	联美控股	97,800	978,000.00	0.07
361	603698	航天工程	65,206	976,785.88	0.07
362	600854	春兰股份	231,900	976,299.00	0.07
363	600896	*ST海投	190,191	973,777.92	0.07
364	601872	招商轮船	269,708	973,645.88	0.07
365	600973	宝胜股份	265,700	969,805.00	0.07
366	600449	宁夏建材	123,000	969,240.00	0.07
367	600853	龙建股份	267,470	968,241.40	0.07
368	600376	首开股份	136,741	961,289.23	0.06
369	600079	人福医药	72,696	961,041.12	0.06
370	600895	张江高科	83,492	960,158.00	0.06
371	600127	金健米业	289,100	959,812.00	0.06
372	600721	百花村	122,991	958,099.89	0.06
373	600373	中文传媒	74,462	956,836.70	0.06
374	600293	三峡新材	168,400	956,512.00	0.06
375	600106	重庆路桥	317,316	951,948.00	0.06
376	600589	广东榕泰	215,300	951,626.00	0.06
377	600128	弘业股份	145,505	951,602.70	0.06
378	600742	一汽富维	77,594	948,974.62	0.06
379	600615	丰华股份	109,400	948,498.00	0.06
380	603090	宏盛股份	62,100	948,267.00	0.06
381	600784	鲁银投资	173,200	945,672.00	0.06
382	600393	粤泰股份	260,900	944,458.00	0.06
383	603798	康普顿	67,700	943,061.00	0.06
384	600820	隧道股份	158,790	938,448.90	0.06

385	600210	紫江企业	277,337	934,625.69	0.06
386	601218	吉鑫科技	354,872	933,313.36	0.06
387	600731	湖南海利	187,100	928,016.00	0.06
388	601718	际华集团	230,078	924,913.56	0.06
389	600567	山鹰纸业	238,400	920,224.00	0.06
390	600475	华光股份	85,900	918,271.00	0.06
391	600655	豫园股份	96,841	915,147.45	0.06
392	600502	安徽水利	227,640	915,112.80	0.06
393	601179	中国西电	267,419	914,572.98	0.06
394	600157	永泰能源	513,229	913,547.62	0.06
395	600099	林海股份	131,600	897,512.00	0.06
396	600200	江苏吴中	118,900	896,506.00	0.06
397	600640	号百控股	87,800	892,926.00	0.06
398	600331	宏达股份	343,827	890,511.93	0.06
399	600827	百联股份	87,185	889,287.00	0.06
400	600718	东软集团	67,992	887,975.52	0.06
401	603188	亚邦股份	86,000	877,200.00	0.06
402	600819	耀皮玻璃	227,000	876,220.00	0.06
403	601126	四方股份	171,800	874,462.00	0.06
404	600664	哈药股份	218,456	867,270.32	0.06
405	600557	康缘药业	69,975	864,191.25	0.06
406	600333	长春燃气	167,909	861,373.17	0.06
407	600218	全柴动力	172,400	858,552.00	0.06
408	600889	南京化纤	154,900	856,597.00	0.06
409	600598	北大荒	93,395	855,498.20	0.06
410	600693	东百集团	142,700	854,773.00	0.06
411	600526	菲达环保	143,700	844,956.00	0.06
412	600126	杭钢股份	140,100	836,397.00	0.06
413	601099	太平洋	356,837	834,998.58	0.06
414	601928	凤凰传媒	135,585	824,356.80	0.06
415	600007	中国国贸	56,758	821,288.26	0.06
416	601689	拓普集团	42,004	816,557.76	0.06
417	601801	皖新传媒	106,000	806,660.00	0.05
418	600480	凌云股份	83,600	804,232.00	0.05
419	600312	平高电气	142,373	802,983.72	0.05
420	600894	广日股份	135,399	802,916.07	0.05
421	600291	西水股份	59,500	794,920.00	0.05
422	600875	东方电气	107,199	794,344.59	0.05
423	600777	新潮能源	360,899	790,368.81	0.05

424	600266	北京城建	83,846	788,152.40	0.05
425	601880	大连港	404,745	785,205.30	0.05
426	601168	西部矿业	124,769	783,549.32	0.05
427	600338	西藏珠峰	37,500	777,000.00	0.05
428	601616	广电电气	257,134	773,973.34	0.05
429	600021	上海电力	114,766	773,522.84	0.05
430	600122	宏图高科	104,300	771,820.00	0.05
431	600268	国电南自	183,229	771,394.09	0.05
432	600758	红阳能源	177,500	770,350.00	0.05
433	600525	长园集团	72,558	766,938.06	0.05
434	600317	营口港	338,574	765,177.24	0.05
435	600500	中化国际	111,590	761,043.80	0.05
436	600067	冠城大通	190,232	755,221.04	0.05
437	600051	宁波联合	118,992	742,510.08	0.05
438	600687	刚泰控股	81,600	741,744.00	0.05
439	600037	歌华有线	71,737	740,325.84	0.05
440	600468	百利电气	133,637	739,012.61	0.05
441	600761	安徽合力	81,099	736,378.92	0.05
442	601000	唐山港	312,000	733,200.00	0.05
443	603118	共进股份	127,900	716,240.00	0.05
444	600682	南京新百	43,400	713,496.00	0.05
445	600277	亿利洁能	132,600	694,824.00	0.05
446	600378	天科股份	71,441	681,547.14	0.05
447	600551	时代出版	77,010	680,768.40	0.05
448	600651	飞乐音响	173,400	676,260.00	0.05
449	600155	宝硕股份	93,400	671,546.00	0.05
450	600717	天津港	89,161	671,382.33	0.05
451	600435	北方导航	82,196	670,719.36	0.05
452	601128	常熟银行	117,200	670,384.00	0.05
453	601717	郑煤机	115,287	669,817.47	0.05
454	601375	中原证券	142,400	665,008.00	0.04
455	600657	信达地产	155,911	662,621.75	0.04
456	600881	亚泰集团	176,265	657,468.45	0.04
457	600804	鹏博士	51,350	616,200.00	0.04
458	601608	中信重工	229,485	596,661.00	0.04
459	600908	无锡银行	98,000	577,220.00	0.04
460	601969	海南矿业	103,300	566,084.00	0.04
461	601208	东材科技	130,370	538,428.10	0.04
462	600123	兰花科创	75,985	529,615.45	0.04

463	600864	哈投股份	110,900	499,050.00	0.03
464	600306	商业城	77,000	498,190.00	0.03
465	600685	中船防务	35,387	472,062.58	0.03
466	601515	东风股份	57,946	447,343.12	0.03
467	600261	阳光照明	114,024	428,730.24	0.03
468	600223	鲁商置业	141,250	399,737.50	0.03
469	600284	浦东建设	74,683	364,453.04	0.02
470	600975	新五丰	84,780	338,272.20	0.02
471	601003	柳钢股份	27,297	216,192.24	0.01
472	601828	美凯龙	13,105	200,244.40	0.01
473	600901	江苏租赁	24,535	185,729.95	0.01
474	603712	七一二	4,022	113,983.48	0.01
475	603056	德邦股份	4,146	113,558.94	0.01
476	601990	南京证券	10,230	110,995.50	0.01
477	603486	科沃斯	1,639	105,338.53	0.01
478	600929	湖南盐业	5,696	88,800.64	0.01
479	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.01
480	603348	文灿股份	2,011	74,246.12	0.01
481	600829	人民同泰	8,843	63,315.88	0.00
482	603897	长城科技	1,595	53,544.15	0.00
483	603301	振德医疗	1,066	52,521.82	0.00
484	603596	伯特利	1,532	52,118.64	0.00
485	603045	福达合金	891	43,427.34	0.00
486	603080	新疆火炬	1,187	40,536.05	0.00
487	600175	美都能源	4,973	20,687.68	0.00
488	603655	朗博科技	880	19,342.40	0.00
489	600267	海正药业	88	1,279.52	0.00
490	600138	中青旅	42	837.06	0.00
491	600162	香江控股	23	57.96	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601066	中信建投	18,690	201,104.40	0.01
2	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00

3	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
4	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
5	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	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	601288	农业银行	30,789,440.21	2.46
2	601857	中国石油	25,197,304.89	2.01
3	601988	中国银行	24,127,404.81	1.93
4	600036	招商银行	20,078,672.19	1.60
5	600519	贵州茅台	18,017,094.52	1.44
6	601318	中国平安	14,063,529.00	1.12
7	600028	中国石化	11,766,847.00	0.94
8	601328	交通银行	11,687,064.73	0.93
9	601628	中国人寿	10,825,233.10	0.86
10	601939	建设银行	9,246,158.82	0.74
11	601088	中国神华	7,822,911.00	0.63
12	600104	上汽集团	7,445,805.87	0.59
13	601166	兴业银行	7,217,177.80	0.58
14	600000	浦发银行	6,881,573.75	0.55
15	600900	长江电力	6,731,861.00	0.54
16	601668	中国建筑	5,315,521.15	0.42
17	601766	中国中车	4,912,503.08	0.39
18	600016	民生银行	4,877,642.00	0.39
19	601601	中国太保	4,747,343.40	0.38
20	601998	中信银行	4,583,663.22	0.37

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，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	601288	农业银行	11,807,726.21	0.94
2	601857	中国石油	10,214,520.00	0.82
3	601988	中国银行	9,216,577.00	0.74
4	600036	招商银行	7,729,720.97	0.62
5	600519	贵州茅台	6,392,712.01	0.51
6	601318	中国平安	5,694,173.29	0.45
7	600028	中国石化	4,841,071.65	0.39
8	601328	交通银行	4,445,232.00	0.36
9	601628	中国人寿	4,415,085.79	0.35
10	601939	建设银行	3,498,014.11	0.28
11	601225	陕西煤业	3,220,343.00	0.26
12	601088	中国神华	2,974,048.85	0.24
13	600104	上汽集团	2,881,315.43	0.23
14	600673	东阳光科	2,800,438.20	0.22
15	601166	兴业银行	2,758,926.06	0.22
16	600000	浦发银行	2,668,283.37	0.21
17	600900	长江电力	2,666,466.53	0.21
18	600031	三一重工	2,346,844.00	0.19
19	601668	中国建筑	2,137,204.00	0.17
20	601766	中国中车	2,093,806.00	0.17

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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	585,805,499.33
卖出股票收入（成交）总额	235,069,967.62

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	224,870.60	0.02

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	224,870.60	0.02

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	113508	新风转债	1,250	121,925.00	0.01
2	110043	无锡转债	1,080	102,945.60	0.01

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投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期期末未持有国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

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	215,287.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,239.63
5	应收申购款	2,251,768.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,488,295.97

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：本基金本报告期末前十名股票中未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

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	603693	江苏新能	48,456.00	0.00	新股流通受限
2	603706	东方环宇	23,103.85	0.00	新股流通受限
3	603105	芯能科技	16,470.30	0.00	新股流通受限

§ 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
39,148	39,818.97	485,000,379.37	31.11%	1,073,832,483.09	68.89%

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	97,339.18	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	1,148,960,948.31
本报告期基金总申购份额	762,169,083.15
减:本报告期基金总赎回份额	352,297,169.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	1,558,832,862.46

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. 《汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 19 日正式生效，胡昕炜先生任该基金的基金经理。
2. 《汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 25 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。
3. 《汇添富熙和精选混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 11 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。
4. 《汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
5. 《汇添富行业整合主题混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，赵鹏程先生任该基金的基金经理。
6. 《汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，陈健玮先生和劳杰男先生任该基金的基金经理。
7. 基金管理人于 2018 年 2 月 14 日公告，增聘胡娜女士担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。
8. 基金管理人 2018 年 3 月 2 日公告，劳杰男先生不再担任汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的基金经理，由李威先生单独管理该基金。
9. 基金管理人于 2018 年 3 月 2 日公告，增聘郑慧莲女士担任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。
10. 《汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 8 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。
11. 基金管理人于 2018 年 3 月 20 日公告，增聘赵鹏飞先生担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生、胡娜女士共同管理该基金。
12. 《汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 23 日正式生效，吴振翔先生和许一尊先生任该基金的基金经理。
13. 基金管理人于 2018 年 4 月 3 日公告，增聘郑慧莲女士担任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。
14. 《汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 16 日正式生效，吴江宏先生和胡娜女士任该基金的基金经理。
15. 《汇添富智能制造股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 23 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。
16. 《汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 26 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
17. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。
18. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 30 天债券型证券

投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

19. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

20. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，徐寅喆女士不再担任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理，增聘陶然先生担任该基金的基金经理，由陶然先生单独管理该基金。

21. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，陆文磊先生和徐寅喆女士不再担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，增聘陶然先生担任该基金的基金经理，由陶然先生单独管理该基金。

22. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，徐寅喆女士不再担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，增聘陶然先生担任该基金的基金经理，由陶然先生单独管理该基金。

23. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富货币市场基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理该基金。

24. 基金管理人 2018 年 5 月 17 日公告，韩贤旺先生和欧阳沁春先生不再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，由杨璿先生单独管理该基金。

25. 《汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2018 年 5 月 23 日正式生效，过蓓蓓女士任该基金的基金经理。

26. 基金管理人 2018 年 5 月 29 日公告，聘任茹奕菡为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年泰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、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富熙和精选混合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。

27. 《汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 6 月 21 日正式生效，杨璿先生任该基金的基金经理。

28. 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。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	2	532,154,870.43	64.94%	495,598.92	64.94%	-
东吴证券	1	218,936,206.69	26.72%	203,896.45	26.72%	-
中信建投	1	68,320,950.44	8.34%	63,628.05	8.34%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-

信达证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-

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	922,251.70	100.00%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

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 1 个交易单元：中泰证券（深交所单元），退租 2 家证券公司的 2 个交易单元：东兴证券（上交所单元）、中投证券（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 2017 年资产净值的公告	公司网站	2018 年 1 月 2 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下证券投资基金执行增值税政策的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 1 月 3 日
3	关于汇添富上证综合指数证券投资基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 1 月 10 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加农业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	2018 年 1 月 12 日
5	汇添富上证综合指数证券投资基金收益分配公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 1 月 16 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于增加基金直销账户的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 1 月 17 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加南洋商业银行为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 1 月 19 日
8	汇添富基金管理有限公司旗下公募基金 2017 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	2018 年 1 月 22 日
9	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	2018 年 1 月 30 日
10	汇添富上证综合指数证券投资基金更新招募说明书（2018 年第 1 号）	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 2 月 13 日
11	关于汇添富基金管理股份有限公司旗下 93 只基金修订基金合同的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 公司网站, 深交所	2018 年 3 月 24 日
12	汇添富基金管理股份有限公司旗下 93 只基金 2017 年年度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018 年 3 月 28 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东亚银行开	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 3 月 30 日

	展的费率优惠活动的公告		
14	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费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 3 月 30 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加工商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	2018 年 3 月 30 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加途牛金服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	2018 年 3 月 31 日
17	关于汇添富基金管理股份有限公司办公楼层调整的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 4 月 9 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电盈基金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	2018 年 4 月 9 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南洋商业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	2018 年 4 月 19 日
20	汇添富基金管理股份有限公司关于住所变更的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018 年 4 月 21 日
21	汇添富基金旗下 99 只基金 2018 年第 1 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018 年 4 月 21 日
22	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加凯石财富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	2018 年 4 月 23 日
23	关于汇添富基金管理股份有限公司增加直销传真号码的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 5 月 31 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	2018 年 6 月 29 日
25	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2018 半年资产净值的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 6 月 30 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 19-22 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

2018 年 8 月 25 日