# 汇添富上证综合指数证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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

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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 汇添富基金管理股份有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李鹏 | 郭明 |
| | 联系电话 | 021-28932888 | 010-66105798 |
| | 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 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.99fund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市富城路99号震旦国际大楼19-22层汇添富基金管理股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(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 |

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

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

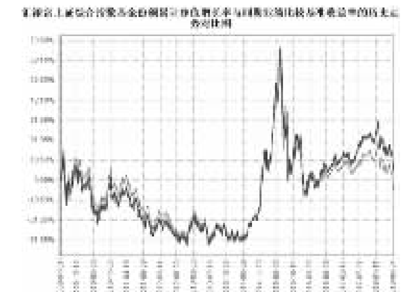
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -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



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,注册资本金为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、汇添富中证精准医疗指数基金、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疗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遵规守信情况的说明

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,基金管理人对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,基本面上,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历,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 | 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 | 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 | 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 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 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 | - | - |
| 资产总计 | 1,481,111,196.35 | 1,253,899,529.49 |
| 负债和所有者权益 | 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 | - | - |
| 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 | 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 | 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 | 1,558,832,862.46 | 1,148,960,948.31 |
| 未分配利润 | -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 | 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 | 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 | 20,662,716.71 | 29,214.08 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 66,935.06 | 50,913.69 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 18,322,674.62 | 11,764,164.80 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -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) | 294,349.16 | 143,727.18 |
| 减:二、费用 | 8,019,521.25 | 6,673,628.18 |
| 1. 管理人报酬 | 5,625,849.46 | 5,282,686.67 |
| 2. 托管费 | 1,125,169.94 | 1,056,537.38 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 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 | 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:

______张晖______ ______李骁______ ____雷青松____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富上证综合指数证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2009]371号文《关于核准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的批复》的核准,由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本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征增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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% |

6.4.8.1.2 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% |

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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× 0.75%/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。

6.4.8.2.2 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× 0.15%/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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 |

6.4.8.6 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。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

| 6.4.9.1.1 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 | - |

6.4.9.2 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 | 重大资产重组停牌 | 6.62 | - | - | 207,487 | 1,659,053.03 | 1,373,563.94 | - |
| 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 | 钱江生化 | 2018年5月2日 | 重大资产重组停牌 | 6.08 | - | - | 180,982 | 1,407,962.77 | 1,100,370.56 | - |
| 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 | 重大资产重组停牌 | 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 | 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 | - |

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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前十名股票投资明细

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 |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.99fund.com网站的半年度报告正文。

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前五名股票投资明细

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 |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.99fund.com网站的半年度报告正文。

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

(下转B709版)