

信息披露 disclosure

汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2014】半年度报告摘要

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:2014年08月25日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人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2014年6月21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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金不受损失。
基金管理人、基金托管人代表其各自基金托管人,在作出投资决策前均仔细阅读本基金的招募说明书及其摘要。
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2014年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况	
基金名称	汇添富深证300ETF联接基金
基金代码	470668
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月24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	44,264,189.50
报告期末基金份额持有人数量	不定期

2.2 基金产品说明	
投资目标	通过投资目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以投资目标ETF为标的指数,主要投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
业绩比较基准	深证300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金主要投资于深证300指数,跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

2.3 基金管理人及基金托管人	
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
信息数据负责人	魏晓 陈健
联系电话	021-29388288 010-66105799
电子邮箱	service@99fund.com cns@icbc.com.cn
客户服务热线	400-888-9118 95588
传真	021-29382998 010-66105798

2.4 信息披露方式	
基金半年度报告备置地点	上海市富城路99号富汇国际大厦15楼汇添富基金管理股份有限公司
基金半年度报告备置点	www.99fund.com

§ 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	
报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	金额单位:人民币元
本期已实现收益	-2753,829.32
本期利润	-2,938,220.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0634
本期基金份额净值增长率	-4.04%
3.1.2 期末基金份额净值	1.0394
期末可供分配基金份额利润	0.0342
期末基金资产净值	41,351,109.02
期末基金份额持有人数量	3,942

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标

本报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

本期已实现收益

-2,753,829.32

本期利润

-2,938,229.24

加权平均基金份额本期利润

-0.0634

本期基金份额净值增长率

-4.04%

3.1.2 期末数据和指标

报告期末(2014年6月30日)

期末可供分配基金份额利润

-0.1094

期末基金资产净值

41,351,109.02

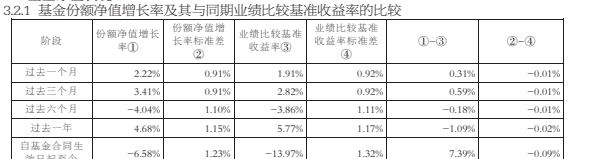
期末基金份额净值

0.9342

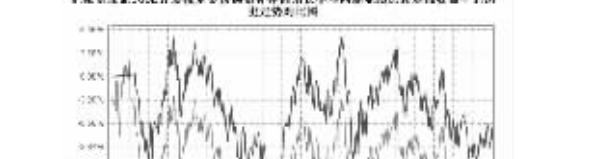
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;

2、期末可供分配利润指截至本报告期末基金未分配利润中,按基金份额持有人持有的基金份额应享有的可分配利润。

注:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的《基金合同》生效日为2011年9月28日,截至本报告期末未满足三年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金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

目前市场整体估值较低,已经反应了较为悲观的预期,机构对周期性板块的配置比例很低,继续下跌的空间有限,随着市场整体估值和盈利能力的回升,权益类资产的价格价值将逐步提高,深证300指数作为市场整体估值的一个风向标,其估值水平将有所回升。

作为被投资标的的指数基金,汇添富深证300ETF联接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,跟踪获取有效收益,并严格控制跟踪误差,保持投资组合与深证300指数的紧密跟踪。我们非常期待汇添富深证300ETF联接基金能够与投资者一起分享中国经济的更好未来。

4.6 管理人对于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》以及中国证监会颁布的《关于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。月末、年中及年末估值核算与基金会计账务的核对同时进行。报告期内,公司制定了《证券投资基金估值政策和程序》,并由投资研究部、产品创新部、基金运营和稽核审计部等部门组成了估值委员会,负责研究、评估基金估值业务,估值委员会成员包括公司各部门人员,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。基金估值委员会由基金估值委员会成员组成,不纳入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提出调整某一估值品种的估值调整建议,并有表决权。会议决策事项有一票否决权,从而将其影响限制在适当范围内,保证基金估值的公平、合理,保持估值的一致性和一贯性。

报告期内,本基金与中国国债登记结算有限责任公司签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,以取得中债收益率曲线和估值服务的说明。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配政策的说明
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四次,每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日可供分配利润的10%;若《基金合同》生效不满3个月可不开行收益分配。

本基金报告期内未进行利润分配。

5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况
报告期内,本基金托管人在对汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中,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
报告期内,汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在投资运作、净值计算、利润分配等方面严格遵守基金合同的约定,基金资产净值计算、基金收益分配、基金费用开支等事项上,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。报告期内,汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本报告期内基金资产估值、净值计算、利润分配等情况的说明
本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制的汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金2014年半年度报告中的财务数据、净值表现、利润分配分配数据、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。

6.1 资产负债情况
会计截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货币资产	2,990,743.72	3,653,207.12
结算备付金	4,292.67	—
应收利息	12,363.95	11,149.95
交易性金融资产	39,239,332.58	68,711,830.91
其中:股票投资	67,080.30	1,459,217.22
基金投资	38,568,532.28	67,252,613.69
客户支持证券资产	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收款项类金融资产	236,765.75	—
应收利息	387.51	919.19
应收股利	—	—
递延所得税资产	10,126.55	32,004.72
其他资产	—	—
资产总计	41,586,037.23	72,489,114.89
负债和所有者权益	—	—
负债:	—	—
短期借款	—	—
应付短期融资券	—	—
应付票据	—	—
应付账款	—	—
应付利息	17,546.78	1,803.99
应付股利	234.95	366.79
应付债券	—	—
应付赎回费	3,987.67	1,703.57
应付税费	—	—
其他负债	—	—
所有者权益	—	—
实收资本	—	—
资本公积	—	—
未分配利润	—	—
所有者权益合计	—	—
负债和所有者权益总计	—	—

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.0342元,基金份额总额44,264,189.50份。

6.2 利润表
会计主体:汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	-2,695,021.58	-3,325,106.53
1.利息收入	9,041.67	26,125.17
其中:存款利息收入	9,041.67	26,125.07
债券利息收入	—	0.10
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)	-2,528,907.48	-3,601,541.03
其中:股票投资收益	-517,047.43	-280,088.76
基金投资收益	-2,018,252.42	-3,321,452.27
债券投资收益	—	133.83
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具损益	—	—
利息收入	6,392.41	1,180.01
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-184,390.92	-3,741,714.48
4.其他收入(损失以“-”号填列)	8,635.11	29,944.73
二、费用	242,806.64	82,696.72
1.管理人费	7,614.51	18,124.76
2.托管费	1,522.83	3,625.01
3.销售服务费	—	—
4.其他费用	—	—
5.其他中	—	—
其中:卖出回购金融资产支出	—	—
6.其他费用	158,670.01	188,544.60
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-2,938,220.24	-3,577,731.27

6.3 所有者权益(净资产)变动表
会计主体:汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	74,157,146.58	1,568,867.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动(基金净值)	-2,938,220.24	-2,938,220.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(基金净值)	-13,388,343.79	-779,920.10
四、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	20,778,093.54	661,392.89
五、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	-33,661,934.33	-98,429.21
六、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	122,427,386.82	-13,718,102.59
七、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
八、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
九、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十一、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十二、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十三、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十四、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十五、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十六、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十七、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十八、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十九、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十一、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十二、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十三、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十四、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十五、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十六、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十七、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十八、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十九、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十一、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十二、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十三、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十四、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十五、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十六、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十七、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十八、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十九、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十一、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十二、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十三、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十四、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十五、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十六、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十七、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十八、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十九、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十一、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十二、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十三、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十四、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十五、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十六、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十七、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十八、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十九、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十一、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十二、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十三、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十四、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十五、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十六、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十七、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十八、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十九、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十一、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十二、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十三、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十四、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十五、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十六、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十七、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十八、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的基金净值变动(基金净值)	—	—