(上接B566版)

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金可进行基金收益分配;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

(2)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资;登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资; 若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式,具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

(3)同一类别内每一基金份额享有同等分配权;

(4)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司(“中金公司”)	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
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
汇添富资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

注:以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年9月6日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中国国际金融股份有限公司	394,154,499.91	100.00%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年9月6日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中国国际金融股份有限公司	5,198.80	100.00%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年9月6日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中国国际金融股份有限公司	2,746,100,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年9月6日(基金合同生效日)至2017年12月31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
中国国际金融股份有限公司	285,667.50	100.00%	231,986.54	100.00%

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017年9月6日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	457,838.64
其中:支付销售机构的客户维护费	15,860.24

注:基金管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5个工作日内支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年9月6日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	91,567.74

注:基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5个工作日内支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017年9月6日(基金合同生效日)至2017年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富沪深300指数(LOF)A	汇添富沪深300指数(LOF)C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	1,203.01	1,203.01
东方证券股份有限公司	-	31,403.11	31,403.11
合计	-	32,606.12	32,606.12

注:本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额的销售服务费年费率为0.25%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日C 类基金份额的基金资产净值的0.25%年费率计提。

计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,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销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5个工作日内支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2017年9月6日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	汇添富沪深300指数(LOF)A	汇添富沪深300指数(LOF)C
基金合同生效日(2017年9月6日)持有的基金份额	10,002,700.27	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,002,700.27	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.5000%	-

注:本公司于2017年8月28日用固有资金10,001,000.00元认购本基金份额10,002,700.27份(含募集期利息结转的份额),认购费用1,000.00元。符合招募说明书规定的认购费率。

7.4.8.4.2 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:本报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注:本基金本报告期末无由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9 期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
002466	天齐锂业	2017年12月26日	2018年1月3日	配股受限	11.06	53.21	1,141	12,619.46	60,712.61	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-

7.4.9.1.2 受限证券类别:债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128024	宁行转债	2017年12月5日	2018年1月12日	未上市	100.00	100.00	667	66,700.00	66,700.00	-
110042	航电转债	2017年12月25日	2018年1月15日	未上市	100.00	100.00	90	9,000.00	9,000.00	-

7.4.9.2 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
600309	万华化学	2017年12月5日	重大资产重组停牌	37.94	-	-	18,300	728,141.68	694,302.00	-
600332	白云山	2017年10月31日	重大资产重组停牌	32.14	2018年1月8日	30.15	9,803	278,630.91	315,068.42	-
002470	金正大	2017年10月25日	重大资产重组停牌	9.15	2018年2月9日	8.24	31,900	268,539.76	291,885.00	-
600157	永泰能源	2017年11月21日	重大资产重组停牌	3.36	-	-	73,200	263,045.88	245,952.00	-
601216	君正集团	2017年12月15日	重大资产重组停牌	4.71	-	-	43,100	216,289.72	203,001.00	-
600150	中国船舶	2017年9月27日	重大资产重组停牌	24.67	2018年3月21日	22.20	3,200	78,477.00	78,944.00	-
600685	中船防务	2017年9月27日	重大资产重组停牌	26.66	2018年3月21日	24.05	1,600	42,199.00	42,656.00	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	重大事项停牌	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1公允价值

7.4.10.1.1不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

7.4. 10.1.2以公允价值计量的金融工具

7.4. 10.1.2.1各层次金融工具公允价值

于2017年12月31日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币136,784,667.22元,属于第二层次的余额为人民币2,057,922.74元,无划分为第三层次的余额。

7.4. 10.1.2.2公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等, 若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4. 10.1.2.3第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4. 10.2承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4. 10.3其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4. 10.4财务报表的批准

本财务报表已于2018年3月21日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	138,766,889.96	94.26
	其中:股票	138,766,889.96	94.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	75,700.00	0.05
	其中:债券	75,700.00	0.05
	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	7,369,897.78	5.01
8	其他各项资产	1,007,491.71	0.68
9	合计	147,219,979.45	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	326,907.00	0.22
B	采矿业	4,545,658.00	3.11
C	制造业	54,253,701.32	37.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,789,734.00	2.59
E	建筑业	5,424,330.81	3.71
F	批发和零售业	2,624,149.22	1.79
G	交通运输、仓储和邮政业	4,488,978.00	3.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,379,151.94	3.68
J	金融业	47,502,012.51	32.48
K	房地产业	6,364,686.00	4.35
L	租赁和商务服务业	1,645,036.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	921,698.00	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	492,926.13	0.34
R	文化、体育和娱乐业	682,418.40	0.47
S	综合	132,990.00	0.09
	合计	138,574,377.33	94.76

8.2.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	174,569.87	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.01
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	-	-
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	192,512.63	0.13

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 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	601318	中国平安	129,500	9,062,410.00	6.20
2	600519	贵州茅台	5,900	4,115,191.00	2.81
3	600036	招商银行	123,100	3,572,362.00	2.44
4	000333	美的集团	53,700	2,976,591.00	2.04
5	601166	兴业银行	150,000	2,548,500.00	1.74
6	000651	格力电器	57,500	2,512,750.00	1.72
7	600016	民生银行	284,500	2,386,955.00	1.63
8	600887	伊利股份	72,233	2,325,180.27	1.59
9	601328	交通银行	330,100	2,049,921.00	1.40
10	000858	五粮液	22,500	1,797,300.00	1.23

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有指数投资股票明细,应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.3.2 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	600150	中国船舶	3,200	78,944.00	0.05
2	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.03
3	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.02
4	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
5	603329	上海雅仕	1,182	17,942.76	0.01

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有积极投资股票明细,应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	14,380,661.00	9.83
2	600036	招商银行	6,368,641.69	4.36
3	600519	贵州茅台	6,263,584.15	4.28
4	601166	兴业银行	5,176,397.00	3.54
5	000333	美的集团	4,800,253.00	3.28
6	600016	民生银行	4,503,469.66	3.08
7	000002	万科A	4,477,476.00	3.06
8	000651	格力电器	4,360,277.00	2.98
9	601328	交通银行	4,055,849.10	2.77
10	600887	伊利股份	3,726,928.45	2.55
11	600000	浦发银行	3,419,102.50	2.34
12	601288	农业银行	3,371,378.00	2.31
13	601668	中国建筑	3,356,584.00	2.30
14	600030	中信证券	3,347,881.00	2.29
15	601398	工商银行	3,090,925.74	2.11
16	002415	海康威视	3,013,112.50	2.06
17	601601	中国太保	2,847,704.00	1.95
18	600837	海通证券	2,794,287.00	1.91
19	000858	五粮液	2,587,074.00	1.77
20	600104	上汽集团	2,552,252.00	1.75

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	8,097,043.13	5.54
2	600519	贵州茅台	3,530,571.00	2.41
3	600036	招商银行	3,247,875.00	2.22
4	000002	万科A	3,123,328.80	2.14
5	000333	美的集团	2,616,331.81	1.79
6	601166	兴业银行	2,475,942.00	1.69
7	000651	格力电器	2,287,518.62	1.56
8	600016	民生银行	2,219,218.75	1.52
9	600887	伊利股份	1,993,688.04	1.36
10	601328	交通银行	1,940,480.00	1.33
11	600030	中信证券	1,655,601.00	1.13
12	601668	中国建筑	1,649,246.00	1.13
13	601288	农业银行	1,607,761.00	1.10
14	002415	海康威视	1,587,915.00	1.09
15	600000	浦发银行	1,577,228.43	1.08
16	601766	中国中车	1,569,362.40	1.07
17	601601	中国太保	1,547,134.00	1.06
18	601398	工商银行	1,502,744.00	1.03
19	000858	五粮液	1,449,677.00	0.99
20	000725	京东方A	1,432,381.00	0.98

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。

8.4.3 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	262,225,486.57
卖出股票收入(成交)总额	132,183,687.95

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。

8.5 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)	75,700.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	75,700.00	0.05

8.6 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	128024	宁行转债	667	66,700.00	0.05
2	110042	航电转债	90	9,000.00	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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

8.8 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

8.9 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投资

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货持仓。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	150,509.41
2	应收证券清算款	652,702.07
3	应收股利	-
4	应收利息	3,593.53
5	应收申购款	200,686.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,007,491.71

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 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	600150	中国船舶	78,944.00	0.05	重大资产重组停牌
2	002919	名臣健康	28,948.46	0.02	重大事项停牌
3	603161	科华控股	20,753.25	0.01	新股流通受限

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	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
汇添富沪深300指数(LOF)A	1,296	67,127.84	10,022,580.27	11.52%	76,975,103.34	88.48%
汇添富沪深300指数(LOF)C	1,102	49,565.83	1,000,180.00	1.83%	53,621,360.93	98.17%
合计	2,398	59,057.22	11,022,760.27	7.78%	130,596,464.27	92.22%

9.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富沪深300指数(LOF)A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	代方婵	1,484,304.00	9.04%
2	刘沅璨	999,270.00	6.09%
3	刘丽新	999,270.00	6.09%
4	吴国渠	686,060.00	4.18%
5	夏海林	581,601.00	3.54%
6	翁秀琼	498,142.00	3.03%
7	郭东民	498,142.00	3.03%
8	翁甲隆	397,722.00	2.42%
9	宣首	351,636.00	2.14%
10	郑文毅	298,816.00	1.82%

汇添富沪深300指数(LOF)C

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	罗晨鹏	1,000,180.00	5.31%
2	李颀	950,042.00	5.05%
3	黄世平	600,027.00	3.19%
4	王立明	500,135.00	2.66%
5	闵美琪	500,090.00	2.66%
6	徐大伟	500,090.00	2.66%
7	刘长戈	500,090.00	2.66%
8	段娜	400,108.00	2.13%
9	许艳玲	320,086.00	1.70%
10	吴红节	300,081.00	1.59%
11	苏良	300,081.00	1.59%
12	胡连吉	300,081.00	1.59%
13	陈令才	300,081.00	1.59%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	汇添富沪深300指数(LOF)A	28,523.25	0.0328%
	汇添富沪深300指数(LOF)C	94,562.65	0.1731%
	合计	123,085.90	0.0869%

9.4 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	份额级别	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	汇添富沪深300指数(LOF)A	0
	汇添富沪深300指数(LOF)C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富沪深300指数(LOF)A	0
	汇添富沪深300指数(LOF)C	0
	合计	0

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,700.27	7.06	10,002,700.27	7.06	3年
基金管理人高级