

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF） 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 28 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 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。

本报告期自 2017 年 8 月 10 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
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	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	22
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	22
§5 托管人报告	23
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	23
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	23
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	23
§6 审计报告	24
6.1 审计报告基本信息	24
6.2 审计报告的基本内容	24
§7 年度财务报表	27
7.1 资产负债表	27
7.2 利润表	28
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	30
7.4 报表附注	31
§8 投资组合报告	62
8.1 期末基金资产组合情况	62
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	62
8.3 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	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	83
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	85
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	85
8.7 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	86

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	86
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	86
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	86
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	86
8.12 投资组合报告附注	87
§9 基金份额持有人信息	89
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	89
9.2 期末上市基金前十名持有人	89
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	90
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	91
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况	91
§10 开放式基金份额变动	92
§11 重大事件揭示	93
11.1 基金份额持有人大会决议	93
11.2 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	93
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	96
11.4 基金投资策略的改变	96
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	96
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	96
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	96
11.8 其他重大事件	97
§12 影响投资者决策的其他重要信息	100
12.1 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	100
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	100
§13 备查文件目录	101
13.1 备查文件目录	101
13.2 存放地点	101
13.3 查阅方式	101

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）	
基金简称	汇添富中证 500 指数（LOF）	
基金主代码	501036	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 8 月 10 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	237,344,583.44 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2017 年 10 月 9 日	
下属分级基金的基金简称：	汇添富中证 500 指数 （LOF）A	汇添富中证 500 指数 （LOF）C
下属分级基金的场内简称：	中证 500A	中证 500C
下属分级基金的交易代码：	501036	501037
报告期末下属分级基金的份额总额	156,313,569.85 份	81,031,013.59 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。

业绩比较基准	中证 500 指数收益率 $\times 95\%$ + 银行人民币活期存款利率（税后） $\times 5\%$
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	郭杰
	联系电话	021-28932888	0755-82943666
	电子邮箱	service@99fund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95565
传真		021-28932998	-
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21-23 层	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层
邮政编码		200120	518026
法定代表人		李文	霍达

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21-23 楼 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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 8 月 10 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日	
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
本期已实现收益	659,604.51	1,122,763.30
本期利润	-6,787,914.61	-1,257,176.11
加权平均基金份额本期利润	-0.0274	-0.0058
本期加权平均净值利润率	-2.76%	-0.58%
本期基金份额净值增长率	-4.92%	-4.96%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	
期末可供分配利润	-7,684,275.90	-4,015,690.89
期末可供分配基金份额利润	-0.0492	-0.0496
期末基金资产净值	148,629,293.95	77,015,322.70
期末基金份额净值	0.9508	0.9504
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	
基金份额累计净值增长率	-4.92%	-4.96%

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。

4、本基金的《基金合同》生效日为 2017 年 8 月 10 日，至本报告期末未满一年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2017 年 12 月 31 日数据，特此说明。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证 500 指数 (LOF) A

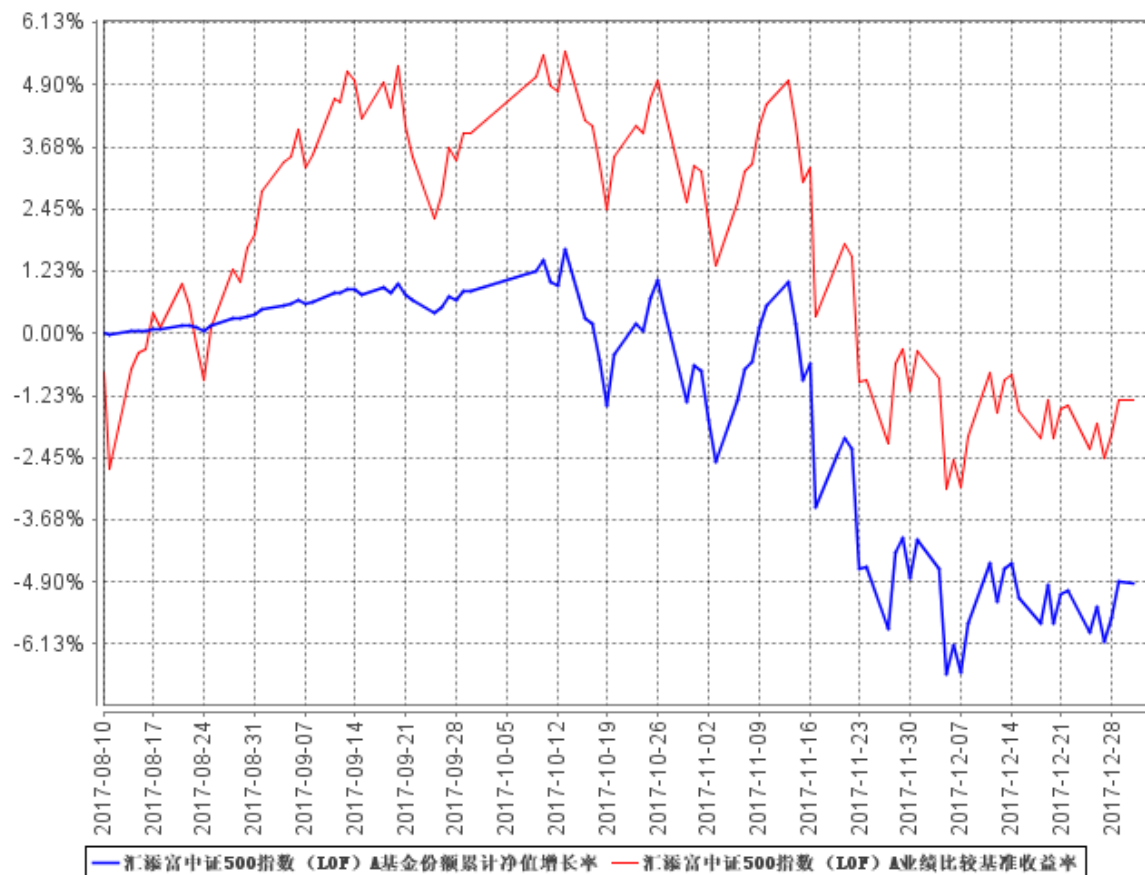
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-5.71%	0.93%	-5.06%	0.93%	-0.65%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	-4.92%	0.73%	-1.31%	0.88%	-3.61%	-0.15%

汇添富中证 500 指数（LOF）C

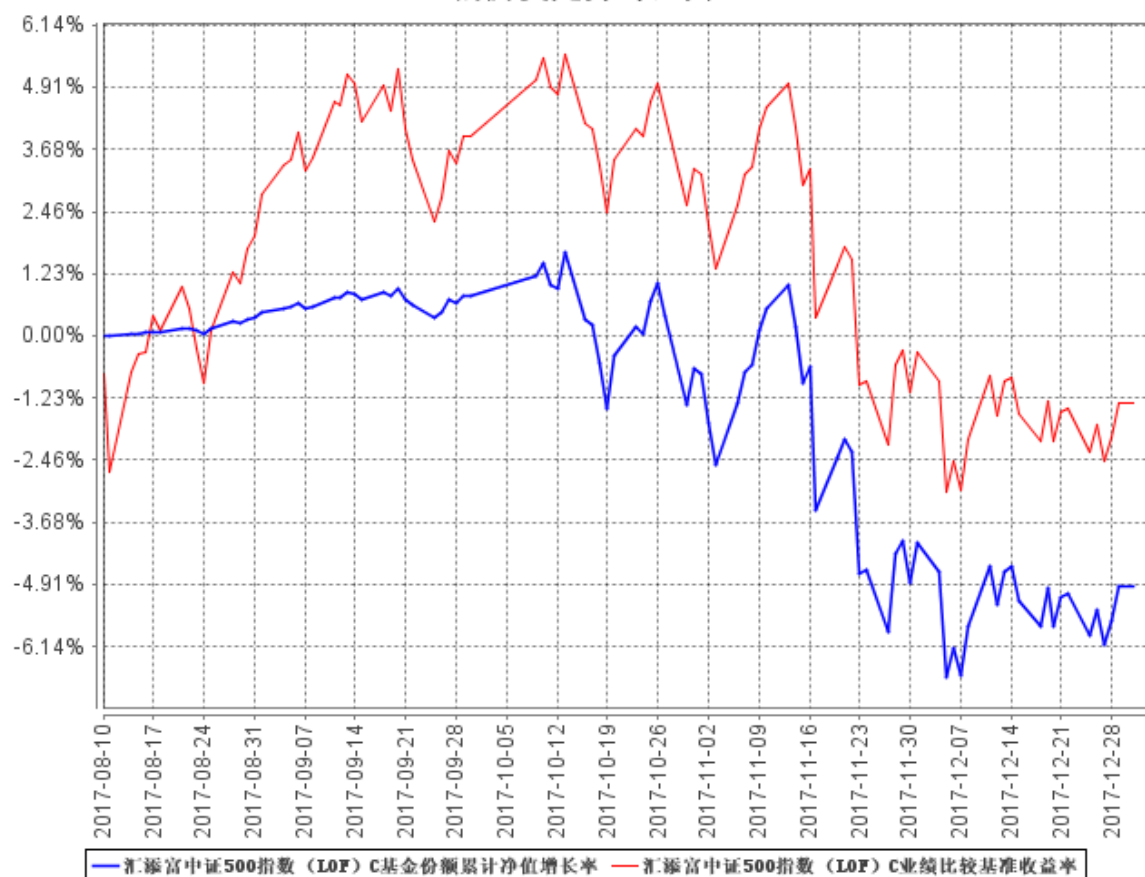
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-5.71%	0.93%	-5.06%	0.93%	-0.65%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	-4.96%	0.73%	-1.31%	0.88%	-3.65%	-0.15%

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

汇添富中证500指数（LOF）A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



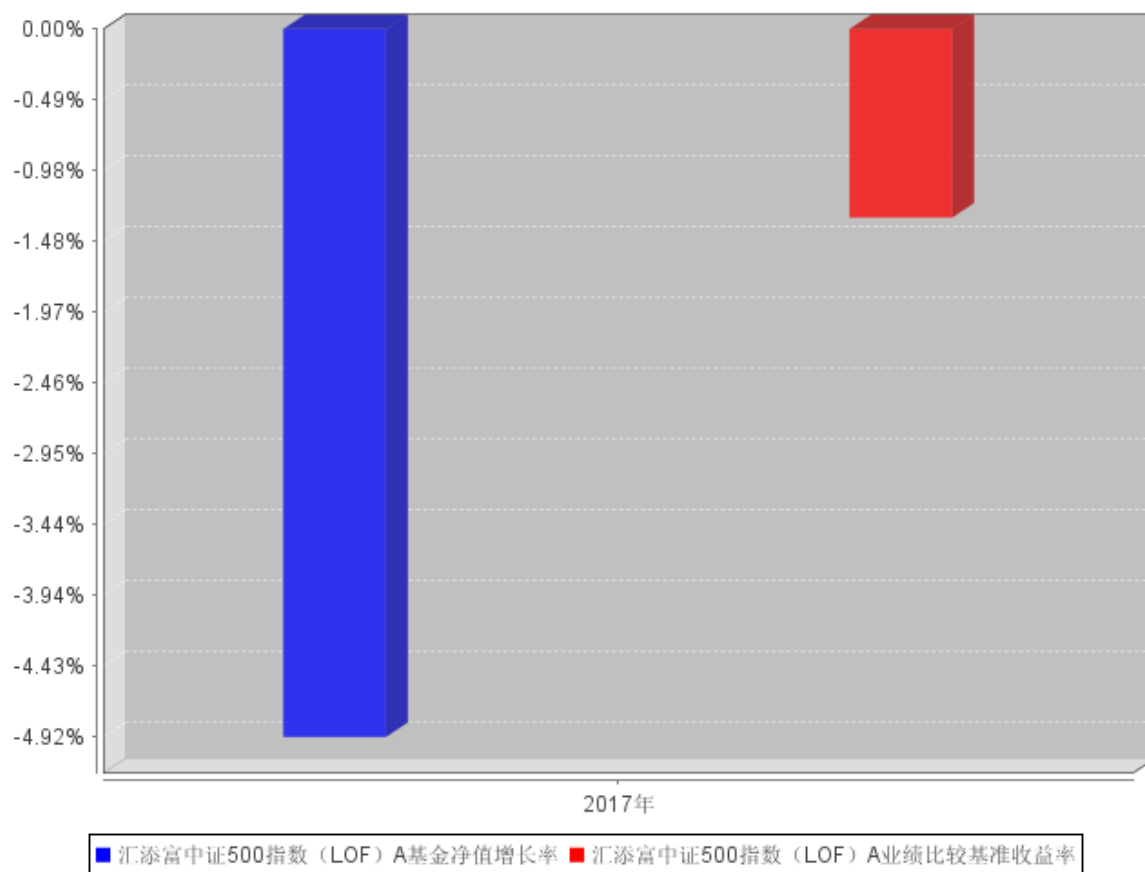
汇添富中证500指数（LOF）C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



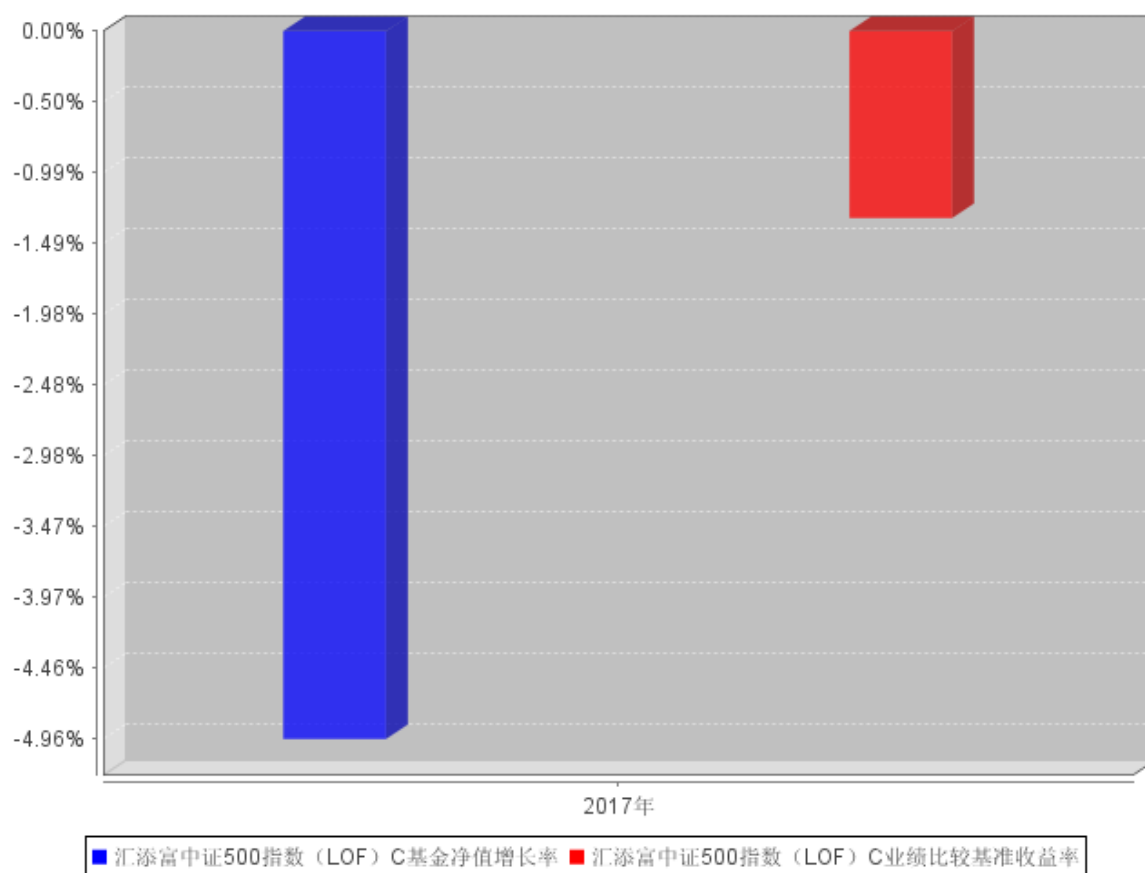
注：本《基金合同》生效之日为 2017 年 8 月 10 日，截至本报告期末，基金成立未满一年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017 年 8 月 10 日）起 6 个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证500指数（LOF）A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



汇添富中证500指数（LOF）C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金的《基金合同》生效日为 2017 年 8 月 10 日，至本报告期末未满 1 年。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金成立于 2017 年 8 月 10 日，2017 年度未进行利润分配。

§ 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

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

目前，汇添富基金已经发展成为长期业绩优异、产品布局完善、业务领域全面、资产管理规模居前的大型基金公司。截至 2017 年 12 月 31 日，汇添富资产管理总规模超过 5500 亿元，其中公募资产管理规模（剔除货基口径）1892 亿元，位居行业第 7；服务客户超过 6000 万人。根据银河证券基金研究中心数据，汇添富旗下股票基金最近 3 年、5 年的股票投资主动管理平均收益率分别达到 89.86%、184.98%，在公募规模（不含货基）前十大基金公司中均排名第一。优秀的业绩赢得了行业与市场的高度认可。2017 年，汇添富基金荣获“金基金•TOP 公司奖”、“三年持续回报明星基金公司”、“优秀资产管理机构”等奖项，汇添富价值精选、汇添富民营活力荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，汇添富上海国企 ETF 荣获“上海金融创新成果奖”，“添富智投”荣登“2017 中国智能投顾新锐榜”。

2017 年，汇添富基金新发行 22 只公募基金，包括 11 只混合型基金，5 只指数基金，3 只债券基金以及 3 只 QDII 基金。其中，上证上海改革发展主题 ETF 为助力国企改革创新产品，汇添富全球移动互联混合基金和汇添富全球医疗保健混合基金布局海外市场，进一步丰富完善了公司的国际产品线。全年，公司管理公募基金产品达到 97 只，涵盖股票型、混合型、债券型、理财、QFII、指数、商品、货币基金等风险程度和预期收益从高到低的各类产品，为投资者提供更加全面的资产配置选择。

2017 年，汇添富基金大力发展自有平台建设，不断引领行业创新。全年推出多款树立行业标

杆的拳头功能：添富智投、添富养老、汇闪付、工资宝、理财日历、在线客服机器人等。规模稳定在千亿级别，服务客户数量超 5000 万，处于行业领先水平。与此同时，互联网金融对外合作业务取得重大突破。截至年底，对外合作伙伴数量已超 80 家，成为业内对外合作最多的公司之一。

2017 年，汇添富基金稳步推行大机构战略，截至年底，公司机构理财总部保有规模达 2900 亿元；获得全国社保基金及基本养老保险基金投资管理人资格，社保基金和基本养老保险基金业务规模快速增长，受托管理组合账户数量持续增加。

2017 年，公司积极开展渠道销售和培训工作，专业的投顾服务以及良好的渠道维护口碑不断提升汇添富品牌在渠道影响力和认可度。同时公司持续大力开展定投、投资者教育、添富论坛等系列客户活动，营销培训活动拓展到银行和券商的网点、营业部。

2017 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，全方位优化客户服务体系。公司通过完善大客户平台建设，搭建了囊括投顾式服务、基金理财、高端客户、现金宝的全新客服体系，为公司各项销售业务提供全方位支持。同时，持续优化电话、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提高客服体验。

2017 年，香港子公司在加强母公司投研一体化基础上，深入发掘港股价值洼地，港股投资及海外债券投资业绩持续优异，汇添富中港策略基金获得晨星三年五星评级，在最近一年、三年、五年同类港股基金中业绩均位列第一；汇添富港币债券基金获得晨星三年四星评级，在同类型基金中持续名列第一。社保海外组合业绩在所有社保管理人中排名第一。

2017 年，公司公益事业蓬勃发展，公益活动精彩纷呈，公益品牌建设更上一个台阶。一是依托公司旗下上海汇添富公益基金会的专业平台，连续第十年开展“河流·孩子”公益助学计划，并成立“河流·孩子”公益助学联盟，将项目的平台化建设推向新的高度。二是将公益事业与公司党建结合，催生出新活力和亮点。公司党委下属的八个党支部分别与各地“添富小学”建立结对关系，党员们通过实地探访，了解学校实际困难和发展需求，积极寻求社会公益资源给予帮助。三是持续开展“河流·孩子”相关品牌活动，延续爱心传递温暖。持续开展“河流·孩子”公益助学计划，组织 100 名添富小学乡村一线教师分赴上海苏州参加专业教师培训；继续组织西部助学公益活动，邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的“添富小学”参加公益服务；继续举办海外留学志愿者支教，帮助山区孩子打开的视野。其余员工公益活动持续精彩纷呈，向公司员工发售筹款台历、参加沪上知名的群众性公益活动——一个鸡蛋的暴走筹款 4 万多元，作为“添富小学”多媒体教室建设费用等。

2018 年，资产管理行业面临重大行业变革期：混业竞争格局下严格依法从严监管；资管业务回归本源，短期业务失去快速扩张的土壤；互联网与金融的融合与碰撞将重构现有行业发展格局；

港股通、沪伦通的发展，带动了 A 股国际化也进一步带来新的机遇与挑战。汇添富基金将始终坚信长期的力量，开拓进取、奋勇前行，为筑造中国梦添砖加瓦，为成为中国最优秀的资产管理公司的梦想努力奋斗！

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、汇添富中证精准医指数基金、中证上海国企 ETF、汇添富中证互联网医疗指数（LOF）、	2017 年 8 月 10 日	-	11 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

	<p>汇添富中证 500 指数（LOF）的基金经理，指数与量化投资部副总监。</p>			<p>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</p>
--	--	--	--	---

					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。
--	--	--	--	--	---

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 公平交易制度和控制方法

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》，本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究环节，公司建立了统一的投研平台信息管理系统，公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时，通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。（2）在投资环节，公司针对基金、专户、社保、境外投资分别设立了投资决策委员会，各委员会根据各自议事规则分别召开会议，在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略，独立制定资产配置计划和组合调整方案，并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。（3）在交易环节，公司实行集

中交易，所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式，按照“时间优先、价格优先、比例分配”的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理，严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配，确保交易的公平性。（4）在交易监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析方面，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。同时，投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

4.3.2 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。报告期内，本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度，进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、清算，以及稽核监察等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3 日、5 日）同向交易的样本，根据 95%置信区间下差价率的 T 检验显著程度、差价率均值是否小于 1%、同向交易占优比等方面进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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 11 次，均是因为投资策略原因，并经过公司内部风控审核。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 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

2017 年，基本上，国内经济延续了稳中向好的态势，企业盈利整体改善，经济保持韧性；国际经济继续复苏，贸易维持较高景气度，出口持续好转。政策面上，十九大报告和中央经济工

作会议指明了未来发展和改革的方向；金融监管力度增强，持续引导经济去杠杆和资本“脱虚向实”，金融服务实体经济；供给侧改革持续推进，结构性减税降费措施密集推出，混改加速，PPP 持续落地，雄安、粤港澳大湾区、长江经济带等协调区域经济协同发展的规划陆续出台。稳健的基本面和改革的大力推进为证券市场提供了较好的环境。

结构上，受益于经济整体复苏，叠加供给侧改革和环保督察对低效率、高污染的落后产能的挤出，部分工业品价格上涨，工业企业利润率有所回升；部分周期行业表现出色。消费对经济增长的拉动作用越来越大，消费者信心指数维持高位，消费升级已成为市场的共识，部分业绩确定性强的消费白马股表现出色。北上资金持续流入，国外投资者对 A 股权益资产的配置逐步提升，边际资金的偏好进一步影响了市场风格，加速了 A 股风格国际化的进程。IPO 加速，“壳价值”大幅下降；外延式并购得到控制。市场流动性较为紧张，成交活跃度下降，一些估值过高的行业和中小盘股票价格出现了一定程度的回调。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富中证 500 指数（LOF）A 基金份额净值为 0.9508 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.92%；截至本报告期末汇添富中证 500 指数（LOF）C 基金份额净值为 0.9504 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.96%；同期业绩比较基准收益率为-1.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年市场投资风格反映的是背后业绩的相对变化，2018 年全球经济仍在复苏过程中，净出口和投资对 GDP 的支撑作用将比 2017 年有所增加，而城市化的持续和人均收入的稳步增长决定了消费升级是今后我国经济增长的一个长期主线，因此，2018 年我国宏观经济面值得期待。在货币政策方面，金融去杠杆、严监管和居民去杠杆在 2018 年仍然是重要工作，防范金融风险也是十九大以来的首要工作之一，因此，在全球进入加息周期的背景下，守住不发生系统性金融风险的底线上，货币政策的操作空间并不大，更多的是结构的调整。

风格上，A 股有进一步向成熟市场靠拢的可能性，推动 2017 年蓝筹行情的资金面及政策面因素仍然存在，基本面质地优良的股票仍可能存在超额收益。但目前估值水平已经逐步反映基本面，在流动性整体变化不大的背景下，行业和个股表现将从极致化的“二八分化”转向相对均衡，不同风格的收益差异相比 2017 年可能减少，A 股市场对业绩及估值匹配的考量将逐渐加大。以中证 500 指数为代表的有良性业绩增长、估值调整到位的中盘股票在 2018 年将获得较好的投资机会。资金在股市的配置将继续看重公司基本面因素，低估值、稳定真成长的股票将继续受到青睐。

作为被动投资的指数型基金，汇添富中证 500LOF 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。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司以维护基金份额持有人利益为宗旨，有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则，认真履行职责，通过常规稽核、专项检查 and 系统监控等方式方法积极开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，促进内部控制和风险管理的不断改进，并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

（一）完善规章制度，健全内部控制体系

在本报告期内，督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估，并根据各项业务特点、业务发展实际，建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程，进一步明确了内部控制和风险管理责任，公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善，为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

（二）加强稽核监察，确保基金运作和公司经营合法合规

本报告期内，督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察，包括对基金投资交易行为、投资指标的监控，对投资组合的风险度量、评估和建议，对基金信息披露的审核、监督，对基金投资、销售、营销的稽核、控制，对基金营运、技术系统的稽核、评估，切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

（三）强化培训教育，提高全员合规意识

本报告期内，督察长和稽核监察部门积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险意识、合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强内部控制和风险管理，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：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，可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。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。

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2018）审字第 60466941_B88 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年 8 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 8 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

	<p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据</p>

	<p>获取的审计证据,就可能导致对汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容 (包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	陈 露	陈 军
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2018 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	12,501,026.91
结算备付金		1,248,640.12
存出保证金		592,135.78
交易性金融资产	7.4.7.2	212,654,271.01
其中：股票投资		212,337,428.18
基金投资		—
债券投资		316,842.83
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		243,095.06
应收利息	7.4.7.5	8,786.41
应收股利		—
应收申购款		42,918.68
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		227,290,873.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 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	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		—
应付赎回款		997,705.72
应付管理人报酬		97,534.98
应付托管费		19,506.99
应付销售服务费		16,771.46
应付交易费用	7.4.7.7	308,424.00
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	206,314.17
负债合计		1,646,257.32
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	237,344,583.44
未分配利润	7.4.7.10	-11,699,966.79
所有者权益合计		225,644,616.65
负债和所有者权益总计		227,290,873.97

注：（1）报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9507 元，基金份额总额 237,344,583.44 份，其中下属 A 类基金份额参考净值 0.9508 元，份额总额 156,313,569.85 份；下属 C 类基金份额参考净值 0.9504 元，份额总额 81,031,013.59 份。

（2）本基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2017 年 12 月 31 日数据，特此说明。

7.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 8 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 8 月 10 日(基金合同生效 日)至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-5,800,557.74
1.利息收入		4,272,826.64
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,947,341.18
债券利息收入		103.47
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,325,381.99
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-408,425.11
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-474,537.36
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	66,112.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-9,827,458.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	162,499.26
减：二、费用		2,244,532.98
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	924,129.53
2. 托管费	7.4.10.2.2	184,825.87
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	217,240.97
4. 交易费用	7.4.7.19	690,971.42
5. 利息支出		-

其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	227,365.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,045,090.72

注：本基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示 2017 年 8 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日数据，特此说明。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 8 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 8 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 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）	735,804,689.63	-	735,804,689.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,045,090.72	-8,045,090.72
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）	-498,460,106.19	-3,654,876.07	-502,114,982.26
其中：1. 基金申购款	14,239,838.28	-192,802.10	14,047,036.18
2. 基金赎回款	-512,699,944.47	-3,462,073.97	-516,162,018.44
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	237,344,583.44	-11,699,966.79	225,644,616.65

金净值)			
------	--	--	--

注：本基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益（基金净值）变动表只列示 2017 年 8 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日数据，特此说明。报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）（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[2017]770 号文《关于准予汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司作为基金发起人于 2017 年 7 月 26 日至 2017 年 8 月 7 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2017)验字第 60466941_B29 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 735,669,673.64 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 135,015.99 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 735,804,689.63 元，折合 735,804,689.63 份基金份额。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于其他股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(分离交易可转债)、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括定期存款、协议存款及其他银行存款)、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

7.4.2 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2017 年 8 月 10 日（基金合同生效日）起至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2017 年 8 月 10 日（基金合同生效日）起至 2017 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。

本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

(8) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

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

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公

司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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) 法律法规或监管机构另有规定的，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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	12,501,026.91
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月~1 年	—
其他存款	—
合计：	12,501,026.91

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	222,216,929.54	212,337,428.18	-9,879,501.36
贵金属投资-金交所 黄金合约	—	—	—

债券	交易所市场	286,800.00	316,842.83	30,042.83
	银行间市场	-	-	-
	合计	286,800.00	316,842.83	30,042.83
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		222,503,729.54	212,654,271.01	-9,849,458.53

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日			
	合同/名义金 额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	1,220,400.00	-	-	
股指期货投资	1,220,400.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	1,220,400.00	-	-	

注：本期末 2017 年 12 月 31 日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量(买/卖)	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
IC1803	1.00	1,220,400.00	1,242,400.00	22,000.00
总额合计：		22,000.00		
减：可抵销期货暂收款		22,000.00		
股指期货投资净额：		0.00		

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	6,375.20
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	2,149.89
应收债券利息	103.47
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	157.85
合计	8,786.41

注：“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	308,424.00
银行间市场应付交易费用	—
合计	308,424.00

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付信息披露费	120,000.00
应付审计费	70,000.00
应付指数使用费	16,314.17
合计	206,314.17

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数（LOF）A		
项目	本期 2017 年 8 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	346,914,435.24	346,914,435.24
本期申购	4,611,796.80	4,611,796.80
本期赎回（以“-”号填列）	-195,212,662.19	-195,212,662.19
- 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	156,313,569.85	156,313,569.85

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数（LOF）C

项目	本期	
	2017 年 8 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	388,890,254.39	388,890,254.39
本期申购	9,628,041.48	9,628,041.48
本期赎回(以“-”号填列)	-317,487,282.28	-317,487,282.28
- 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	81,031,013.59	81,031,013.59

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2) 本基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 735,669,673.64 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 135,015.99 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 735,804,689.63 元，折合 735,804,689.63 份基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	659,604.51	-7,447,519.12	-6,787,914.61
本期基金份额交易产生的变动数	-832,332.05	-64,029.24	-896,361.29
其中：基金申购款	14,680.70	-127,539.33	-112,858.63
基金赎回款	-847,012.75	63,510.09	-783,502.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-172,727.54	-7,511,548.36	-7,684,275.90

单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,122,763.30	-2,379,939.41	-1,257,176.11
本期基金份额交易产生的变动数	-1,244,693.41	-1,513,821.37	-2,758,514.78
其中：基金申购款	39,401.72	-119,345.19	-79,943.47
基金赎回款	-1,284,095.13	-1,394,476.18	-2,678,571.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-121,930.11	-3,893,760.78	-4,015,690.89

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 8 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	459,206.20
定期存款利息收入	2,464,000.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	22,979.30
其他	1,155.68
合计	2,947,341.18

注：其他包括结算保证金利息收入和直销申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 8 月 10 日(基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	154,700,781.73
减：卖出股票成本总额	155,175,319.09

买卖股票差价收入	-474, 537. 36
----------	---------------

7.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.13.1 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。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 8 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	66, 112. 25
基金投资产生的股利收益	-
合计	66, 112. 25

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 8 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-9, 849, 458. 53
——股票投资	-9, 879, 501. 36
——债券投资	30, 042. 83
——资产支持证券投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	22,000.00
——权证投资	-
股指期货	22,000.00
3. 其他	-
合计	-9,827,458.53

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 8 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	162,499.26
合计	162,499.26

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 8 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	690,971.42
银行间市场交易费用	-
合计	690,971.42

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 8 月 10 日(基金合同生效日)至 2017
----	--------------------------------------

	年 12 月 31 日
审计费用	70,000.00
信息披露费	120,000.00
银行划款费	—
指数使用费	36,965.19
其他费用	400.00
合计	227,365.19

注：“其他费用”：支付股东账户开户费。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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、基金销售机构、基金发起人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	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的关键管理人员

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 8 月 10 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
招商证券股份有限公司	531,301,758.95	100.00%

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 8 月 10 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
招商证券股份有限公司	2,618,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年8月10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

招商证券股份有 限公司	489,103.99	100.00%	308,424.00	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 8 月 10 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	924,129.53
其中：支付销售机构的客户维护费	41,458.03

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：

$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 8 月 10 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	184,825.87

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 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 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

7.4.10.2.3 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 8 月 10 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		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
招商证券股份有限公司	-	2,187.41	2,187.41
汇添富基金管理股份有限公司	-	1,032.45	1,032.45
东方证券股份有限公司	-	61,776.68	61,776.68
合计	-	64,996.54	64,996.54

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

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 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 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	
	2017 年 8 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2017 年 8 月 10 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	6.4000%	—

注：本基金于 2017 年 8 月 10 日成立。本公司于 2017 年 8 月 2 日用自有资金 10,001,000.00 元认购本基金份额 10,002,700.27 份(基金成立时利息结转的份额为 2,700.27 份)，认购费用 1000.00 元。符合招募说明书规定的认购费率。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末均未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注：本基金本报告期末无由关联方保管的银行存款余额，本报告期末未有由关联方保管银行存款而产生的利息收入。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.12.2 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
600525	长园集团	2017 年 12 月 25 日	重大事项停牌	15.79	2018 年 1 月 10 日	17.30	67,900	1,263,453.26	1,072,141.00	-
000930	中粮生化	2017 年 10 月 24 日	重大资产重组停牌	13.34	-	-	69,100	940,686.49	921,794.00	-
002366	台海核电	2017 年 12 月 6 日	重大资产重组	26.45	-	-	28,500	793,498.01	753,825.00	-

			停牌							
300383	光环新网	2017 年 11 月 7 日	重大资产重组停牌	13.19	2018 年 3 月 19 日	14.51	56,300	805,711.41	742,597.00	-
000547	航天发展	2017 年 10 月 30 日	重大资产重组停牌	10.83	-	-	68,400	809,322.09	740,772.00	-
000566	海南海药	2017 年 11 月 22 日	重大资产重组停牌	12.89	-	-	45,700	602,073.62	589,073.00	-
600614	鹏起科技	2017 年 12 月 26 日	重大资产重组停牌	10.16	-	-	54,700	666,377.49	555,752.00	-
002512	达华智能	2017 年 12 月 6 日	重大资产重组停牌	18.07	2018 年 3 月 6 日	16.26	30,200	561,011.38	545,714.00	-
000401	冀东水泥	2017 年 11 月 21 日	重大资产重组停牌	13.79	2018 年 1 月 15 日	15.17	38,400	654,971.19	529,536.00	-
002004	华邦健康	2017 年 12 月 14 日	重大事项停牌	6.73	2018 年 3 月 14 日	7.30	73,700	576,801.52	496,001.00	-

		日								
002745	木林森	2017 年 12 月 28 日	重大资产重组停牌	45.50	2018 年 1 月 5 日	46.50	10,900	509,444.00	495,950.00	-
000939	凯迪生态	2017 年 11 月 16 日	重大资产重组停牌	4.99	-	-	91,100	498,839.96	454,589.00	-
300159	新研股份	2017 年 11 月 23 日	重大资产重组停牌	10.40	2018 年 3 月 22 日	9.36	42,500	521,996.51	442,000.00	-
000926	福星股份	2017 年 12 月 26 日	重大事项停牌	10.89	2018 年 1 月 10 日	11.98	39,100	483,901.09	425,799.00	-
600187	国中水务	2017 年 11 月 9 日	重大资产重组停牌	4.68	2018 年 3 月 20 日	4.21	84,500	386,887.43	395,460.00	-
600645	中源协和	2017 年 10 月 9 日	重大资产重组停牌	25.26	2018 年 1 月 19 日	25.56	15,200	377,664.00	383,952.00	-
300116	坚瑞沃能	2017 年 12 月 18 日	重大资产重组	7.62	-	-	50,300	520,233.62	383,286.00	-

		日	停牌							
600664	哈药股份	2017 年 9 月 28 日	重大资产重组停牌	5.81	2018 年 2 月 27 日	6.00	62,000	362,476.00	360,220.00	-
300134	大富科技	2017 年 12 月 18 日	重大资产重组停牌	16.45	2018 年 3 月 19 日	14.81	20,700	380,658.77	340,515.00	-
000156	华数传媒	2017 年 12 月 26 日	重大资产重组停牌	11.40	-	-	29,700	384,253.46	338,580.00	-
002122	天马股份	2017 年 12 月 19 日	重大资产重组停牌	8.49	-	-	36,800	391,120.30	312,432.00	-
002358	森源电气	2017 年 12 月 7 日	重大资产重组停牌	14.86	2018 年 3 月 7 日	15.05	20,500	323,348.47	304,630.00	-
300010	立思辰	2017 年 11 月 17 日	重大资产重组停牌	11.17	2018 年 2 月 22 日	10.05	25,300	322,558.27	282,601.00	-
002344	海宁皮城	2017 年 11 月 1 日	重大资产重组	7.93	2018 年 1 月 31 日	7.44	33,800	280,836.83	268,034.00	-

			停牌							
300032	金龙 机电	2017 年 11 月 27 日	重大 资产 重组 停牌	13.89	-	-	19,200	288,249.15	266,688.00	-
002345	潮宏 基	2017 年 12 月 20 日	重大 资产 重组 停牌	10.75	-	-	24,700	270,814.86	265,525.00	-
000006	深振 业 A	2017 年 9 月 11 日	重大 资产 重组 停牌	9.85	2018 年 3 月 8 日	8.87	22,300	188,377.00	219,655.00	-
000979	中弘 股份	2017 年 9 月 7 日	重大 资产 重组 停牌	1.94	2018 年 2 月 14 日	1.75	109,200	212,852.00	211,848.00	-
300730	科创 信息	2017 年 12 月 25 日	重大 事项 停牌	41.55	2018 年 1 月 2 日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
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	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	12,501,026.91	-	-	-	-	-	12,501,026.91
结算备付金	1,248,640.12	-	-	-	-	-	1,248,640.12
存出保证金	318,807.78	-	-	-	-	273,328.00	592,135.78

交易性金融资产	-	-316,842.83	-	-212,337,428.18	212,654,271.01
应收证券清算款	-	-	-	243,095.06	243,095.06
应收利息	-	-	-	8,786.41	8,786.41
应收申购款	37,175.93	-	-	5,742.75	42,918.68
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,105,650.74	-316,842.83	-	212,868,380.40	227,290,873.97
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	0.00
应付赎回款	-	-	-	997,705.72	997,705.72
应付管理人报酬	-	-	-	97,534.98	97,534.98
应付托管费	-	-	-	19,506.99	19,506.99
应付销售服务费	-	-	-	16,771.46	16,771.46
应付交易费用	-	-	-	308,424.00	308,424.00
其他负债	-	-	-	206,314.17	206,314.17
负债总计	-	-	-	1,646,257.32	1,646,257.32
利率敏感度缺口	14,105,650.74	-316,842.83	-	-211,222,123.08	225,644,616.65

注：上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金持有的可转债的市场风险在附注 7.4.13.4.3.2 中进行披露；除此之外，本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2017 年 12 月 31 日，本基金成立未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 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。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 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 199,476,097.80 元，属于第二层次的余额为人民币 13,178,173.21 元，无划分为第三层次的余额。

7.4.14.1.2.2 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。

7.4.14.1.2.3 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。

7.4.14.2 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。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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	212,337,428.18	93.42
	其中：股票	212,337,428.18	93.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	316,842.83	0.14
	其中：债券	316,842.83	0.14
	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	13,749,667.03	6.05
8	其他各项资产	886,935.93	0.39
9	合计	227,290,873.97	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	3,157,286.00	1.40
B	采矿业	7,387,232.00	3.27
C	制造业	126,028,781.32	55.85

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,952,201.00	3.08
E	建筑业	4,944,713.00	2.19
F	批发和零售业	11,498,237.99	5.10
G	交通运输、仓储和邮政业	7,023,957.00	3.11
H	住宿和餐饮业	268,007.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,847,845.80	7.91
J	金融业	4,045,402.00	1.79
K	房地产业	11,761,322.40	5.21
L	租赁和商务服务业	3,703,585.43	1.64
M	科学研究和技术服务业	383,952.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	2,405,268.00	1.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	259,870.00	0.12
Q	卫生和社会工作	401,540.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	2,847,567.00	1.26
S	综合	1,111,776.00	0.49
	合计	212,028,543.94	93.97

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	240,685.73	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供	16,143.20	0.01

	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	34,112.55	0.02
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	308,884.24	0.14

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：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 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

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	600516	方大炭素	55,300	1,597,064.00	0.71

2	600201	生物股份	46,360	1,471,466.40	0.65
3	600176	中国巨石	90,200	1,469,358.00	0.65
4	002405	四维图新	52,900	1,396,031.00	0.62
5	000661	长春高新	7,101	1,299,483.00	0.58
6	002422	科伦药业	44,603	1,110,614.70	0.49
7	002271	东方雨虹	27,295	1,090,708.20	0.48
8	600525	长园集团	67,900	1,072,141.00	0.48
9	002001	新和成	28,100	1,069,486.00	0.47
10	600584	长电科技	49,100	1,047,303.00	0.46
11	000786	北新建材	46,100	1,037,250.00	0.46
12	000998	隆平高科	38,900	1,000,508.00	0.44
13	002340	格林美	137,600	989,344.00	0.44
14	300274	阳光电源	52,200	979,794.00	0.43
15	600438	通威股份	80,100	970,011.00	0.43
16	600521	华海药业	31,700	954,804.00	0.42
17	603019	中科曙光	23,279	936,746.96	0.42
18	600426	华鲁恒升	58,400	929,728.00	0.41
19	000930	中粮生化	69,100	921,794.00	0.41
20	002049	紫光国芯	18,800	902,212.00	0.40
21	600315	上海家化	24,300	896,427.00	0.40
22	000039	中集集团	39,200	895,720.00	0.40
23	002092	中泰化学	66,300	882,453.00	0.39
24	600079	人福医药	48,800	870,592.00	0.39
25	300266	兴源环境	32,100	866,700.00	0.38
26	000050	深天马 A	43,500	857,385.00	0.38
27	000830	鲁西化工	52,800	840,576.00	0.37
28	002583	海能达	45,200	836,652.00	0.37
29	600298	安琪酵母	25,500	834,360.00	0.37

30	600642	申能股份	140,700	824,502.00	0.37
31	600256	广汇能源	161,600	817,696.00	0.36
32	601168	西部矿业	98,600	808,520.00	0.36
33	000009	中国宝安	111,200	803,976.00	0.36
34	002179	中航光电	20,400	803,352.00	0.36
35	002050	三花智控	43,700	801,458.00	0.36
36	600291	西水股份	33,900	797,328.00	0.35
37	600392	盛和资源	41,900	796,100.00	0.35
38	000977	浪潮信息	40,000	795,200.00	0.35
39	002410	广联达	40,500	793,800.00	0.35
40	002384	东山精密	27,615	785,922.90	0.35
41	600004	白云机场	53,300	783,510.00	0.35
42	000418	小天鹅 A	11,400	773,490.00	0.34
43	600879	航天电子	98,000	768,320.00	0.34
44	000488	晨鸣纸业	45,900	765,153.00	0.34
45	600388	龙净环保	44,200	764,660.00	0.34
46	002311	海大集团	32,600	762,840.00	0.34
47	002573	清新环境	33,300	756,909.00	0.34
48	002366	台海核电	28,500	753,825.00	0.33
49	601233	桐昆股份	33,500	753,415.00	0.33
50	300055	万邦达	35,800	752,874.00	0.33
51	000513	丽珠集团	11,300	750,885.00	0.33
52	002078	太阳纸业	80,600	747,968.00	0.33
53	300383	光环新网	56,300	742,597.00	0.33
54	300088	长信科技	94,700	741,501.00	0.33
55	000547	航天发展	68,400	740,772.00	0.33
56	600022	山东钢铁	338,500	724,390.00	0.32
57	600499	科达洁能	65,000	720,850.00	0.32

58	000690	宝新能源	90,100	720,800.00	0.32
59	600872	中炬高新	28,904	715,663.04	0.32
60	603589	口子窖	15,498	713,682.90	0.32
61	600600	青岛啤酒	18,000	707,940.00	0.31
62	601699	潞安环能	61,800	703,284.00	0.31
63	600811	东方集团	152,900	700,282.00	0.31
64	600875	东方电气	62,000	696,260.00	0.31
65	000887	中鼎股份	38,300	695,911.00	0.31
66	002176	江特电机	60,800	688,256.00	0.31
67	600056	中国医药	27,600	686,964.00	0.30
68	002019	亿帆医药	30,800	685,300.00	0.30
69	600885	宏发股份	16,500	682,605.00	0.30
70	000656	金科股份	137,800	682,110.00	0.30
71	002407	多氟多	33,400	682,028.00	0.30
72	600166	福田汽车	240,500	675,805.00	0.30
73	000066	中国长城	91,400	666,306.00	0.30
74	600839	四川长虹	190,300	662,244.00	0.29
75	002517	恺英网络	29,700	659,637.00	0.29
76	600718	东软集团	44,900	658,234.00	0.29
77	600643	爱建集团	59,400	658,152.00	0.29
78	002038	双鹭药业	21,200	656,564.00	0.29
79	000997	新大陆	36,600	656,238.00	0.29
80	600755	厦门国贸	64,300	649,430.00	0.29
81	002439	启明星辰	27,800	649,130.00	0.29
82	600183	生益科技	37,500	647,250.00	0.29
83	002273	水晶光电	27,403	646,436.77	0.29
84	600418	江淮汽车	68,300	646,118.00	0.29
85	600325	华发股份	87,300	642,528.00	0.28

86	600260	凯乐科技	22,000	640,420.00	0.28
87	600808	马钢股份	154,400	637,672.00	0.28
88	600266	北京城建	48,400	635,976.00	0.28
89	002359	北讯集团	28,100	633,655.00	0.28
90	000970	中科三环	43,900	631,282.00	0.28
91	002244	滨江集团	79,200	629,640.00	0.28
92	600138	中青旅	30,000	626,100.00	0.28
93	600787	中储股份	56,900	625,900.00	0.28
94	000878	云南铜业	44,000	624,360.00	0.28
95	000581	威孚高科	26,000	624,000.00	0.28
96	600060	海信电器	40,400	606,808.00	0.27
97	002223	鱼跃医疗	30,800	603,680.00	0.27
98	600673	东阳光科	89,400	603,450.00	0.27
99	002670	国盛金控	31,000	602,950.00	0.27
100	600460	士兰微	38,700	597,141.00	0.26
101	002195	二三四五	101,600	593,344.00	0.26
102	000566	海南海药	45,700	589,073.00	0.26
103	002285	世联行	52,600	586,490.00	0.26
104	000825	太钢不锈	117,900	584,784.00	0.26
105	002408	齐翔腾达	45,700	579,476.00	0.26
106	600160	巨化股份	54,300	577,209.00	0.26
107	300197	铁汉生态	47,200	573,480.00	0.25
108	600094	大名城	82,000	573,180.00	0.25
109	000960	锡业股份	43,200	570,240.00	0.25
110	600435	北方导航	46,200	569,646.00	0.25
111	300146	汤臣倍健	37,900	569,258.00	0.25
112	300182	捷成股份	66,100	569,121.00	0.25
113	002640	跨境通	29,700	568,458.00	0.25

114	600884	杉杉股份	29,000	562,020.00	0.25
115	300115	长盈精密	28,000	561,960.00	0.25
116	600978	宜华生活	61,400	561,196.00	0.25
117	600655	豫园股份	52,100	559,554.00	0.25
118	600614	鹏起科技	54,700	555,752.00	0.25
119	601000	唐山港	117,900	555,309.00	0.25
120	600062	华润双鹤	22,400	554,400.00	0.25
121	600143	金发科技	84,300	553,851.00	0.25
122	000807	云铝股份	54,000	552,420.00	0.24
123	600282	南钢股份	114,100	552,244.00	0.24
124	000703	恒逸石化	25,600	552,192.00	0.24
125	000999	华润三九	20,300	552,160.00	0.24
126	002512	达华智能	30,200	545,714.00	0.24
127	600179	安通控股	22,000	544,500.00	0.24
128	000981	银亿股份	61,600	543,928.00	0.24
129	002183	怡亚通	76,800	541,440.00	0.24
130	600970	中材国际	54,500	539,005.00	0.24
131	000778	新兴铸管	102,800	536,616.00	0.24
132	002013	中航机电	49,500	534,105.00	0.24
133	601231	环旭电子	33,800	533,026.00	0.24
134	002051	中工国际	28,800	530,784.00	0.24
135	000401	冀东水泥	38,400	529,536.00	0.23
136	002589	瑞康医药	38,800	521,860.00	0.23
137	002048	宁波华翔	21,900	521,220.00	0.23
138	002221	东华能源	42,500	518,925.00	0.23
139	000988	华工科技	31,200	517,296.00	0.23
140	002127	南极电商	42,297	515,600.43	0.23
141	000732	泰禾集团	25,700	514,514.00	0.23

142	600503	华丽家族	78,500	514,175.00	0.23
143	600409	三友化工	53,400	512,106.00	0.23
144	600125	铁龙物流	47,100	509,622.00	0.23
145	002373	千方科技	34,300	502,495.00	0.22
146	000598	兴蓉环境	92,500	502,275.00	0.22
147	600240	华业资本	58,400	501,072.00	0.22
148	002268	卫士通	21,730	500,224.60	0.22
149	600161	天坛生物	17,300	498,067.00	0.22
150	002004	华邦健康	73,700	496,001.00	0.22
151	002745	木林森	10,900	495,950.00	0.22
152	002491	通鼎互联	39,100	492,660.00	0.22
153	000729	燕京啤酒	72,800	490,672.00	0.22
154	000078	海王生物	82,100	484,390.00	0.21
155	002030	达安基因	25,900	481,222.00	0.21
156	002400	省广股份	90,200	480,766.00	0.21
157	600410	华胜天成	45,700	480,764.00	0.21
158	600635	大众公用	100,000	478,000.00	0.21
159	600597	光明乳业	31,500	477,225.00	0.21
160	300166	东方国信	38,000	476,900.00	0.21
161	600566	济川药业	12,500	476,875.00	0.21
162	002281	光迅科技	16,200	476,280.00	0.21
163	002440	闰土股份	23,800	468,622.00	0.21
164	600037	歌华有线	36,000	467,640.00	0.21
165	002152	广电运通	62,800	467,232.00	0.21
166	000685	中山公用	45,500	466,375.00	0.21
167	600122	宏图高科	47,900	464,151.00	0.21
168	000028	国药一致	7,700	463,925.00	0.21
169	000089	深圳机场	53,100	461,970.00	0.20

170	000012	南玻 A	54,600	461,370.00	0.20
171	600307	酒钢宏兴	161,000	460,460.00	0.20
172	600348	阳泉煤业	62,300	459,774.00	0.20
173	600500	中化国际	53,900	455,994.00	0.20
174	600572	康恩贝	64,400	455,308.00	0.20
175	002056	横店东磁	42,500	454,750.00	0.20
176	000939	凯迪生态	91,100	454,589.00	0.20
177	600380	健康元	40,600	454,314.00	0.20
178	600717	天津港	43,300	454,217.00	0.20
179	002431	棕榈股份	53,900	452,760.00	0.20
180	600267	海正药业	29,900	452,686.00	0.20
181	600171	上海贝岭	27,800	452,306.00	0.20
182	601200	上海环境	18,100	451,414.00	0.20
183	002131	利欧股份	172,892	449,519.20	0.20
184	600863	内蒙华电	150,300	446,391.00	0.20
185	000975	银泰资源	33,400	446,224.00	0.20
186	601880	大连港	159,500	445,005.00	0.20
187	600881	亚泰集团	84,100	444,048.00	0.20
188	002506	协鑫集成	103,900	443,653.00	0.20
189	300324	旋极信息	30,300	443,289.00	0.20
190	300058	蓝色光标	80,200	442,704.00	0.20
191	600511	国药股份	15,900	442,020.00	0.20
192	300159	新研股份	42,500	442,000.00	0.20
193	000636	风华高科	37,100	440,748.00	0.20
194	002665	首航节能	65,700	437,562.00	0.19
195	002028	思源电气	27,500	435,875.00	0.19
196	300002	神州泰岳	71,000	434,520.00	0.19
197	600026	中远海能	70,800	433,296.00	0.19

198	002280	联络互动	56,300	431,258.00	0.19
199	002477	雏鹰农牧	96,700	429,348.00	0.19
200	002191	劲嘉股份	46,400	429,200.00	0.19
201	600416	湘电股份	34,300	428,407.00	0.19
202	600120	浙江东方	17,400	428,214.00	0.19
203	002249	大洋电机	61,300	427,261.00	0.19
204	000926	福星股份	39,100	425,799.00	0.19
205	600737	中粮糖业	52,800	419,760.00	0.19
206	600967	内蒙一机	34,800	419,340.00	0.19
207	002354	天神娱乐	24,300	415,530.00	0.18
208	600936	广西广电	60,500	415,030.00	0.18
209	000400	许继电气	31,300	412,847.00	0.18
210	600633	浙数文化	27,000	410,400.00	0.18
211	600466	蓝光发展	43,800	409,530.00	0.18
212	600835	上海机电	16,700	409,150.00	0.18
213	600575	皖江物流	100,500	407,025.00	0.18
214	000612	焦作万方	43,300	407,020.00	0.18
215	002635	安洁科技	15,600	407,004.00	0.18
216	600751	天海投资	66,600	406,926.00	0.18
217	002709	天赐材料	8,800	404,712.00	0.18
218	603369	今世缘	26,000	403,260.00	0.18
219	000667	美好置业	132,300	402,192.00	0.18
220	002505	大康农业	141,600	402,144.00	0.18
221	300244	迪安诊断	17,000	401,540.00	0.18
222	600216	浙江医药	29,800	400,512.00	0.18
223	300026	红日药业	93,400	397,884.00	0.18
224	000860	顺鑫农业	20,700	397,647.00	0.18
225	600064	南京高科	28,000	397,320.00	0.18

226	300133	华策影视	36,600	396,744.00	0.18
227	600598	北大荒	36,800	396,704.00	0.18
228	600187	国中水务	84,500	395,460.00	0.18
229	600151	航天机电	52,000	394,680.00	0.17
230	000596	古井贡酒	6,000	394,020.00	0.17
231	300199	翰宇药业	24,200	393,976.00	0.17
232	000712	锦龙股份	23,200	393,936.00	0.17
233	002371	北方华创	9,500	393,680.00	0.17
234	300113	顺网科技	21,500	393,235.00	0.17
235	000758	中色股份	61,100	392,873.00	0.17
236	600478	科力远	53,100	391,878.00	0.17
237	002353	杰瑞股份	29,700	389,664.00	0.17
238	300253	卫宁健康	57,800	387,838.00	0.17
239	002603	以岭药业	24,800	385,888.00	0.17
240	300287	飞利信	52,000	385,320.00	0.17
241	002444	巨星科技	27,800	384,474.00	0.17
242	603766	隆鑫通用	54,700	383,994.00	0.17
243	600645	中源协和	15,200	383,952.00	0.17
244	300116	坚瑞沃能	50,300	383,286.00	0.17
245	002701	奥瑞金	60,900	380,625.00	0.17
246	600823	世茂股份	77,000	380,380.00	0.17
247	600039	四川路桥	93,200	379,324.00	0.17
248	002807	江阴银行	45,600	377,568.00	0.17
249	002128	露天煤业	34,000	376,720.00	0.17
250	600908	无锡银行	47,600	374,612.00	0.17
251	000027	深圳能源	61,700	373,902.00	0.17
252	002390	信邦制药	44,200	373,490.00	0.17
253	600086	东方金钰	34,900	371,685.00	0.16

254	600017	日照港	95,500	370,540.00	0.16
255	000021	深科技	37,900	368,767.00	0.16
256	002147	新光圆成	28,310	366,331.40	0.16
257	603077	和邦生物	183,100	366,200.00	0.16
258	002002	鸿达兴业	53,300	364,572.00	0.16
259	002299	圣农发展	25,300	364,320.00	0.16
260	002155	湖南黄金	37,300	361,810.00	0.16
261	600664	哈药股份	62,000	360,220.00	0.16
262	600648	外高桥	19,400	358,900.00	0.16
263	600158	中体产业	34,700	356,716.00	0.16
264	600801	华新水泥	25,200	356,076.00	0.16
265	600563	法拉电子	7,000	355,670.00	0.16
266	600366	宁波韵升	20,200	353,904.00	0.16
267	300001	特锐德	25,800	353,202.00	0.16
268	000681	视觉中国	18,100	352,950.00	0.16
269	002266	浙富控股	81,400	352,462.00	0.16
270	601678	滨化股份	43,000	349,160.00	0.15
271	600312	平高电气	34,900	348,651.00	0.15
272	000528	柳工	40,800	348,024.00	0.15
273	600848	上海临港	15,600	347,880.00	0.15
274	002672	东江环保	21,400	347,750.00	0.15
275	002308	威创股份	28,400	346,480.00	0.15
276	002032	苏泊尔	8,500	343,230.00	0.15
277	000718	苏宁环球	78,700	340,771.00	0.15
278	600317	营口港	100,500	340,695.00	0.15
279	300134	大富科技	20,700	340,515.00	0.15
280	000563	陕国投 A	79,800	339,150.00	0.15
281	000762	西藏矿业	21,600	339,120.00	0.15

282	000156	华数传媒	29,700	338,580.00	0.15
283	002489	浙江永强	56,100	337,161.00	0.15
284	000877	天山股份	32,400	336,960.00	0.15
285	000727	华东科技	140,300	333,914.00	0.15
286	002018	华信国际	47,100	332,997.00	0.15
287	600594	益佰制药	32,500	332,150.00	0.15
288	600108	亚盛集团	80,700	331,677.00	0.15
289	600393	粤泰股份	52,300	331,582.00	0.15
290	600651	飞乐音响	35,900	328,485.00	0.15
291	002368	太极股份	12,900	327,273.00	0.15
292	600859	王府井	16,000	326,400.00	0.14
293	002428	云南锗业	27,000	325,890.00	0.14
294	600270	外运发展	18,700	323,136.00	0.14
295	002251	步步高	17,900	323,095.00	0.14
296	600545	卓郎智能	29,400	322,812.00	0.14
297	600611	大众交通	64,600	321,708.00	0.14
298	002463	沪电股份	60,200	320,866.00	0.14
299	600169	太原重工	92,500	320,050.00	0.14
300	601928	凤凰传媒	39,400	319,534.00	0.14
301	600993	马应龙	15,600	319,488.00	0.14
302	000937	冀中能源	54,700	318,354.00	0.14
303	000501	鄂武商 A	19,900	317,604.00	0.14
304	600316	洪都航空	22,300	315,768.00	0.14
305	600729	重庆百货	12,600	315,756.00	0.14
306	002375	亚厦股份	41,600	312,832.00	0.14
307	002122	天马股份	36,800	312,432.00	0.14
308	002437	誉衡药业	45,200	311,428.00	0.14
309	000090	天健集团	31,000	311,240.00	0.14

310	002663	普邦股份	55,900	310,245.00	0.14
311	603000	人民网	28,600	309,738.00	0.14
312	000587	金洲慈航	44,000	308,000.00	0.14
313	600770	综艺股份	40,500	307,800.00	0.14
314	600694	大商股份	9,100	306,943.00	0.14
315	600259	广晟有色	7,800	306,462.00	0.14
316	600141	兴发集团	18,100	305,890.00	0.14
317	002250	联化科技	28,700	304,794.00	0.14
318	002358	森源电气	20,500	304,630.00	0.14
319	601717	郑煤机	46,000	302,680.00	0.13
320	002277	友阿股份	51,300	301,131.00	0.13
321	600557	康缘药业	22,300	300,604.00	0.13
322	600098	广州发展	42,300	299,061.00	0.13
323	600582	天地科技	64,200	298,530.00	0.13
324	002064	华峰氨纶	60,700	297,430.00	0.13
325	002106	莱宝高科	29,200	296,964.00	0.13
326	600565	迪马股份	74,100	296,400.00	0.13
327	603188	亚邦股份	17,800	295,302.00	0.13
328	002233	塔牌集团	24,700	294,177.00	0.13
329	002434	万里扬	27,900	292,950.00	0.13
330	600874	创业环保	22,500	292,725.00	0.13
331	601311	骆驼股份	21,900	290,175.00	0.13
332	300297	蓝盾股份	30,400	290,016.00	0.13
333	600765	中航重机	24,000	288,480.00	0.13
334	000848	承德露露	30,400	287,584.00	0.13
335	002022	科华生物	21,100	287,171.00	0.13
336	000600	建投能源	37,100	286,041.00	0.13
337	000519	中兵红箭	29,000	285,650.00	0.13

338	000426	兴业矿业	29,000	285,070.00	0.13
339	600338	西藏珠峰	6,800	283,220.00	0.13
340	300010	立思辰	25,300	282,601.00	0.13
341	000969	安泰科技	31,700	281,813.00	0.12
342	601016	节能风电	85,400	280,966.00	0.12
343	601689	拓普集团	11,300	279,562.00	0.12
344	000541	佛山照明	30,300	278,760.00	0.12
345	000543	皖能电力	55,500	278,610.00	0.12
346	002657	中科金财	12,200	278,404.00	0.12
347	603883	老百姓	4,401	277,218.99	0.12
348	600587	新华医疗	16,500	277,035.00	0.12
349	600155	宝硕股份	27,000	276,210.00	0.12
350	600073	上海梅林	34,000	276,080.00	0.12
351	002276	万马股份	32,000	275,840.00	0.12
352	002123	梦网集团	26,600	275,310.00	0.12
353	600277	亿利洁能	42,500	273,700.00	0.12
354	600687	刚泰控股	23,100	272,811.00	0.12
355	000572	海马汽车	59,400	272,052.00	0.12
356	000158	常山北明	34,200	271,548.00	0.12
357	600971	恒源煤电	25,900	270,137.00	0.12
358	002242	九阳股份	15,900	269,823.00	0.12
359	002690	美亚光电	14,000	269,780.00	0.12
360	002332	仙琚制药	33,000	269,610.00	0.12
361	002073	软控股份	33,700	269,600.00	0.12
362	002317	众生药业	21,200	268,816.00	0.12
363	600058	五矿发展	22,200	268,176.00	0.12
364	000061	农产品	35,000	268,100.00	0.12
365	002344	海宁皮城	33,800	268,034.00	0.12

366	600754	锦江股份	8,300	268,007.00	0.12
367	600580	卧龙电气	33,400	267,534.00	0.12
368	002261	拓维信息	34,500	267,030.00	0.12
369	600284	浦东建设	28,700	266,910.00	0.12
370	300032	金龙机电	19,200	266,688.00	0.12
371	002503	搜于特	48,100	266,474.00	0.12
372	002345	潮宏基	24,700	265,525.00	0.12
373	603816	顾家家居	4,500	265,365.00	0.12
374	600773	西藏城投	22,600	263,968.00	0.12
375	601002	晋亿实业	24,600	263,958.00	0.12
376	002063	远光软件	24,800	263,624.00	0.12
377	600300	维维股份	60,300	263,511.00	0.12
378	600869	智慧能源	45,900	263,466.00	0.12
379	000062	深圳华强	11,200	263,088.00	0.12
380	000829	天音控股	27,500	261,250.00	0.12
381	600422	昆药集团	28,500	260,775.00	0.12
382	601001	大同煤业	43,100	260,755.00	0.12
383	603377	东方时尚	6,500	259,870.00	0.12
384	000680	山推股份	51,000	259,590.00	0.12
385	002642	荣之联	19,800	259,578.00	0.12
386	300273	和佳股份	28,600	259,116.00	0.11
387	600578	京能电力	69,800	258,260.00	0.11
388	002254	泰和新材	22,100	257,244.00	0.11
389	603515	欧普照明	6,000	257,040.00	0.11
390	000669	金鸿控股	17,500	256,375.00	0.11
391	002681	奋达科技	22,900	255,564.00	0.11
392	002699	美盛文化	14,100	255,351.00	0.11
393	300202	聚龙股份	14,200	254,890.00	0.11

394	600536	中国软件	15,400	254,870.00	0.11
395	002482	广田集团	31,700	254,234.00	0.11
396	000049	德赛电池	6,400	253,376.00	0.11
397	002544	杰赛科技	16,000	251,680.00	0.11
398	600458	时代新材	24,900	250,743.00	0.11
399	600428	中远海特	44,400	249,084.00	0.11
400	600759	洲际油气	58,400	248,784.00	0.11
401	600623	华谊集团	29,100	248,223.00	0.11
402	300257	开山股份	17,700	247,800.00	0.11
403	300039	上海凯宝	38,800	246,768.00	0.11
404	600006	东风汽车	41,300	241,605.00	0.11
405	002479	富春环保	24,700	239,837.00	0.11
406	600750	江中药业	9,400	239,512.00	0.11
407	600335	国机汽车	21,300	239,412.00	0.11
408	300291	华录百纳	21,000	238,350.00	0.11
409	002005	德豪润达	54,600	238,056.00	0.11
410	000777	中核科技	15,900	236,910.00	0.10
411	002707	众信旅游	21,700	236,313.00	0.10
412	000652	泰达股份	53,300	235,053.00	0.10
413	600395	盘江股份	34,200	234,954.00	0.10
414	600059	古越龙山	25,000	234,750.00	0.10
415	600280	中央商场	29,700	233,739.00	0.10
416	002041	登海种业	18,100	232,585.00	0.10
417	603658	安图生物	4,300	228,846.00	0.10
418	002011	盾安环境	28,400	228,336.00	0.10
419	600517	置信电气	35,100	227,097.00	0.10
420	000897	津滨发展	66,800	225,784.00	0.10
421	000990	诚志股份	13,000	224,380.00	0.10

422	600639	浦东金桥	13,200	223,740.00	0.10
423	603328	依顿电子	15,500	222,425.00	0.10
424	000006	深振业 A	22,300	219,655.00	0.10
425	600657	信达地产	39,300	219,294.00	0.10
426	600329	中新药业	14,700	218,589.00	0.10
427	603198	迎驾贡酒	12,400	218,116.00	0.10
428	600757	长江传媒	31,200	216,840.00	0.10
429	600195	中牧股份	11,000	216,810.00	0.10
430	603556	海兴电力	5,900	214,760.00	0.10
431	300147	香雪制药	23,900	214,383.00	0.10
432	002269	美邦服饰	65,000	213,850.00	0.09
433	000979	中弘股份	109,200	211,848.00	0.09
434	600862	中航高科	21,600	209,088.00	0.09
435	600880	博瑞传播	39,600	208,692.00	0.09
436	600894	广日股份	22,200	207,570.00	0.09
437	002342	巨力索具	34,600	207,254.00	0.09
438	603355	莱克电气	4,201	207,025.28	0.09
439	000552	靖远煤电	58,800	206,976.00	0.09
440	600628	新世界	20,100	204,417.00	0.09
441	603444	吉比特	1,100	202,323.00	0.09
442	002588	史丹利	29,800	199,362.00	0.09
443	000099	中信海直	22,000	198,440.00	0.09
444	002093	国脉科技	20,800	197,392.00	0.09
445	300043	星辉娱乐	32,200	197,064.00	0.09
446	002118	紫鑫药业	26,100	196,272.00	0.09
447	002190	成飞集成	9,000	194,760.00	0.09
448	600184	光电股份	10,600	194,192.00	0.09
449	000662	天夏智慧	13,000	193,310.00	0.09

450	603888	新华网	8,100	191,565.00	0.08
451	603868	飞科电器	2,500	189,375.00	0.08
452	601127	小康股份	9,400	189,034.00	0.08
453	000816	智慧农业	58,800	188,748.00	0.08
454	002392	北京利尔	37,000	186,480.00	0.08
455	002325	洪涛股份	38,700	184,599.00	0.08
456	600748	上实发展	28,400	182,044.00	0.08
457	600292	远达环保	20,200	180,790.00	0.08
458	600640	号百控股	12,300	179,826.00	0.08
459	600776	东方通信	24,600	177,858.00	0.08
460	600743	华远地产	48,200	176,412.00	0.08
461	601020	华钰矿业	8,200	168,264.00	0.07
462	600481	双良节能	41,900	168,019.00	0.07
463	002414	高德红外	9,700	163,057.00	0.07
464	600053	九鼎投资	6,700	160,063.00	0.07
465	600996	贵广网络	16,100	159,390.00	0.07
466	002551	尚荣医疗	17,300	158,468.00	0.07
467	002416	爱施德	16,000	151,520.00	0.07
468	603568	伟明环保	7,100	149,455.00	0.07
469	000761	本钢板材	28,300	147,160.00	0.07
470	603806	福斯特	4,200	143,220.00	0.06
471	603225	新凤鸣	4,000	143,200.00	0.06
472	600826	兰生股份	10,800	142,236.00	0.06
473	000536	华映科技	28,700	141,778.00	0.06
474	603228	景旺电子	2,601	139,855.77	0.06
475	600126	杭钢股份	20,100	138,087.00	0.06
476	000987	越秀金控	13,700	134,945.00	0.06
477	603169	兰石重装	15,900	133,401.00	0.06

478	600618	氯碱化工	11,700	126,711.00	0.06
479	603001	奥康国际	8,300	120,101.00	0.05
480	603528	多伦科技	12,800	113,024.00	0.05
481	000025	特力 A	2,900	111,679.00	0.05
482	600289	ST 信通	11,200	111,328.00	0.05
483	601811	新华文轩	8,200	110,126.00	0.05
484	601969	海南矿业	11,100	98,235.00	0.04
485	600917	重庆燃气	8,800	98,032.00	0.04
486	601128	常熟银行	12,700	90,551.00	0.04
487	002815	崇达技术	2,801	88,399.56	0.04
488	603877	太平鸟	3,000	81,330.00	0.04
489	603025	大豪科技	2,602	76,550.84	0.03
490	600939	重庆建工	10,300	76,426.00	0.03
491	603569	长久物流	3,100	74,989.00	0.03
492	002818	富森美	2,300	69,713.00	0.03
493	001696	宗申动力	7,000	44,240.00	0.02

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	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.02
2	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.02
3	300730	科创信息	821	34,112.55	0.02
4	603848	好太太	1,377	31,244.13	0.01
5	603917	合力科技	1,022	29,014.58	0.01
6	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01
7	300727	润禾材料	870	28,701.30	0.01

8	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
9	603329	上海雅仕	1,182	17,942.76	0.01
10	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.01
11	603655	朗博科技	880	8,184.00	0.00

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	002460	赣锋锂业	3,625,000.92	1.61
2	300136	信维通信	2,692,301.94	1.19
3	600516	方大炭素	2,675,616.00	1.19
4	601012	隆基股份	2,631,915.00	1.17
5	600487	亨通光电	2,523,937.00	1.12
6	002405	四维图新	2,095,638.50	0.93
7	600525	长园集团	2,043,110.00	0.91
8	603799	华友钴业	2,016,119.00	0.89
9	600219	南山铝业	1,828,661.00	0.81
10	002572	索菲亚	1,785,178.00	0.79
11	002340	格林美	1,765,879.00	0.78
12	000661	长春高新	1,748,549.00	0.77
13	600201	生物股份	1,743,373.00	0.77
14	600643	爱建集团	1,707,607.00	0.76
15	002092	中泰化学	1,670,979.82	0.74
16	002271	东方雨虹	1,666,477.00	0.74
17	600176	中国巨石	1,630,656.83	0.72

18	000050	深天马 A	1,603,986.00	0.71
19	000998	隆平高科	1,560,611.39	0.69
20	600291	西水股份	1,558,302.00	0.69

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	300136	信维通信	3,424,409.00	1.52
2	601012	隆基股份	3,359,177.76	1.49
3	002460	赣锋锂业	3,291,544.00	1.46
4	600487	亨通光电	3,086,678.00	1.37
5	603799	华友钴业	2,041,875.88	0.90
6	002572	索菲亚	1,714,955.00	0.76
7	600219	南山铝业	1,688,453.00	0.75
8	300296	利亚德	1,437,084.00	0.64
9	300122	智飞生物	1,178,784.00	0.52
10	002217	合力泰	1,168,359.43	0.52
11	600699	均胜电子	1,152,349.19	0.51
12	600809	山西汾酒	1,144,630.72	0.51
13	600528	中铁工业	917,765.00	0.41
14	000697	炼石有色	847,940.10	0.38
15	002601	龙鳞佰利	837,596.00	0.37
16	000661	长春高新	836,136.31	0.37
17	600516	方大炭素	814,635.00	0.36
18	600643	爱建集团	794,705.00	0.35
19	600525	长园集团	772,270.00	0.34
20	600176	中国巨石	725,164.00	0.32

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	377,392,248.63
卖出股票收入（成交）总额	154,700,781.73

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）	316,842.83	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	316,842.83	0.14

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	113015	隆基转债	1,080	127,882.80	0.06
2	110040	生益转债	510	55,222.80	0.02

3	128020	水晶转债	541	52,958.49	0.02
4	128016	雨虹转债	384	43,806.72	0.02
5	128022	众信转债	193	19,983.22	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。

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。

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1803	IC1803	1	1,242,400.00	22,000.00	-
公允价值变动总额合计（元）					22,000.00
股指期货投资本期收益（元）					0.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					22,000.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等，以降低交易成本和组合风险，提高投资效率。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：报告期末本基金无国债期货持仓。

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、处罚的情形。

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	592,135.78
2	应收证券清算款	243,095.06
3	应收股利	-
4	应收利息	8,786.41
5	应收申购款	42,918.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	886,935.93

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

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	600525	长园集团	1,072,141.00	0.48	重大事项停牌

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	300730	科创信息	34,112.55	0.02	重大事项停牌

§ 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 中证 500 指 数(LOF) A	2,399	65,157.80	11,001,745.27	7.04%	145,311,824.58	92.96%
汇添富 中证 500 指 数(LOF) C	1,366	59,319.92	2,300,400.50	2.84%	78,730,613.09	97.16%
合计	3,765	63,039.73	13,302,145.77	5.60%	224,042,437.67	94.40%

9.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证 500 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	龚利红	1,252,740.00	4.69%
2	赵凤英	999,090.00	3.74%
3	周旭	828,799.00	3.10%
4	梁艳芬	547,832.00	2.05%
5	王曜蔚	508,013.00	1.90%

6	陈胜昔	498,299.00	1.86%
7	范福来	498,142.00	1.86%
8	杨丽君	498,029.00	1.86%
9	林寿康	400,000.00	1.50%
10	黄伟颖	397,722.00	1.49%

汇添富中证 500 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	刘世智	1,000,135.00	1.23%
2	魏华	750,033.00	0.93%
3	张效伟	700,085.00	0.86%
4	杨锋	700,063.00	0.86%
5	曹霞玺	600,175.00	0.74%
6	杨莉	500,157.00	2.19%
7	吴淑燕	500,045.00	2.19%
8	郑芳	400,126.00	1.75%
9	赖明华	375,022.00	1.64%
10	于文华	300,175.00	1.31%

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	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	26,346.42	0.0169%
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	—	0.0000%

	合计	26,346.42	0.0111%
--	----	-----------	---------

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	汇添富中证 500 指数（LOF）A	0
	汇添富中证 500 指数（LOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 500 指数（LOF）A	0
	汇添富中证 500 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	4.21	10,002,700.27	4.21	3 年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	—	—	—
基金经理等人员	0.00	0.00	—	—	—
基金管理人股东	0.00	0.00	—	—	—
其他	26,346.42	0.01	—	—	—
合计	10,029,046.69	4.23	10,002,700.27	4.21	—

注：本公司于 2017 年 8 月 2 日运用固有资金 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。截至本期末，基金管理人持有本基金 10,002,700.27 份，从业人员持有 26,346.42 份。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 500 指数（LOF）A	汇添富中证 500 指数（LOF）C
基金合同生效日（2017 年 8 月 10 日）基金份额总额	346,914,435.24	388,890,254.39
本报告期期初基金份额总额	—	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,611,796.80	9,628,041.48
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	195,212,662.19	317,487,282.28
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期期末基金份额总额	156,313,569.85	81,031,013.59

注：表内“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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 《汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日正式生效，韩贤旺先生任该基金的基金经理。
2. 基金管理人于 2017 年 2 月 4 日公告，增聘欧阳沁春先生和杨璿先生担任汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与韩贤旺先生共同管理该基金。
3. 《汇添富鑫利债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 13 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。
4. 基金管理人于 2017 年 3 月 10 日公告，李骁先生任基金管理人副总经理。
5. 《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 15 日正式生效，顾耀强先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。
6. 基金管理人于 2017 年 3 月 16 日公告，增聘吴江宏先生担任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理，与顾耀强先生共同管理该基金。
7. 《汇添富中国高端制造股票型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 20 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。
8. 《汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 14 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。
9. 《汇添富精选美元债债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，何旻先生和高欣先生任该基金的基金经理。
10. 《汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
11. 《汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
12. 《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 15 日正式生效，曾刚先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。
13. 基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，聘任郑慧莲女士为汇添富年年丰定期开放混合型

证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金和汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

14. 基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理该基金。

15. 基金管理人 2017 年 6 月 21 日公告，雷鸣先生不再担任汇添富新兴消费股票型证券投资基金的基金经理，由刘伟林先生单独管理该基金。

16. 《汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 6 月 23 日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。

17. 《汇添富添福吉祥混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 7 月 24 日正式生效，何旻先生任该基金的基金经理。

18. 基金管理人于 2017 年 7 月 29 日公告，增聘胡昕炜先生担任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理，与何旻先生共同管理该基金。

19. 《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 8 月 10 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

20. 《汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 8 月 16 日正式生效，刘江先生担任该基金的基金经理。

21. 《汇添富盈润混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 6 日正式生效，何旻先生任该基金的基金经理。

22. 《汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 9 月 6 日正式生效，楚天舒女士任该基金的基金经理。

23. 基金管理人于 2017 年 9 月 8 日公告，增聘陶然先生为汇添富现金宝货币市场基金、汇添富添富通货币市场基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理上述基金。

24. 基金管理人于 2017 年 9 月 21 日公告，增聘胡昕炜先生为汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理，与何旻先生共同管理该基金。

25. 《汇添富民丰回报混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 27 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。

26. 基金管理人于 2017 年 9 月 28 日公告，增聘赵鹏飞先生为汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生共同管理该基金。

27. 《汇添富弘安混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 29 日正式生效，何旻先生和赵鹏飞先生任该基金的基金经理。

28. 《汇添富睿丰混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 29 日正式生效，李怀定先生任该基金的基金经理。

29. 基金管理人于 2017 年 9 月 30 日公告，增聘赵鹏飞先生为汇添富睿丰混合型证券投资基金的基金经理，与李怀定先生共同管理该基金。

30. 《汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 11 月 10 日正式生效，余中强先生和倪健先生任该基金的基金经理。

31. 《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）基金合同》于 2017 年 11 月 24 日正式生效，赖中立先生任该基金的基金经理。

32. 《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基金合同》于 2017 年 12 月 1 日正式生效，楚天舒女士任该基金的基金经理。

33. 《汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 12 月 4 日正式生效，楚天舒女士任该基金的基金经理。

34. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘董瑾女士为中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）和汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）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。

35. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理，与何旻先生、曾刚先生共同管理该基金。

36. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。

37. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与李怀定先生、陆文磊先生、胡娜女士共同管理该基金。

38. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

39. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富双利债券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。

40. 基金管理人于 2017 年 12 月 27 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

41. 基金管理人于 2017 年 12 月 27 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生、蒋文玲女士共同管理该基金。

42. 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。

11.3 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，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2017 年 8 月 10 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币柒万元整。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
招商证券		2531,301,758.95	100.00%	489,103.99	100.00%	-

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。

11.7.2 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
招商证券	-	-	2,618,000,000.00	100.00%	-	-

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 2 个交易单元：招商证券（上交所单元和深交所单元）。

11.8 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	汇添富中证 500 指数型发起	中证报, 上交所, 证	2017 年 7 月 5 日

	式证券投资基金（LOF）发行文件	券时报, 上证报, 公司网站	
2	关于汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）增加代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 7 月 26 日
3	关于汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）增加长城国瑞证券为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 7 月 27 日
4	关于汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）参与方正证券和民族证券开展的认购费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 8 月 1 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）提前结束募集的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 8 月 4 日
6	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同生效公告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 8 月 11 日
7	关于汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）开通跨系统转托管业务的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 9 月 27 日
8	关于汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）参加部分代销机构定投基金、申购基金费率优惠活动的公	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 9 月 27 日

	告		
9	关于汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 9 月 27 日
10	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）A 类份额、C 类份额上市交易公告书	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 9 月 27 日
11	关于汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）A 类份额、C 类份额上市交易提示性公告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 10 月 9 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 11 月 24 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加众禄金融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	2017 年 12 月 14 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加南京证券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	2017 年 12 月 22 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定投基金费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2017 年 12 月 29 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）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。

13.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21-23 楼 汇添富基金管理股份有限公司

13.3 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 3 月 28 日