

汇添富上证综合指数证券投资基金 2018 年 年度报告

2018 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 月 26 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 22 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 2018 年 1 月 1 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50

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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	65
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	65
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	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	66
§ 9 基金份额持有人信息	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	67
§ 10 开放式基金份额变动	67
§ 11 重大事件揭示	68
11.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
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	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.8 其他重大事件	75
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	78
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	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§ 13 备查文件目录	78
13.1 备查文件目录	78
13.2 存放地点	78
13.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富上证综合指数证券投资基金
基金简称	汇添富上证综合指数
基金主代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 7 月 1 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,543,394,010.35 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		李文	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金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 20 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	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 层

§ 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	31,488,528.91	95,817,548.49	16,010,169.22
本期利润	-285,193,129.63	162,255,176.68	-156,251,589.43
加权平均基金份额本期利润	-0.1929	0.1221	-0.1055
本期加权平均净值利润率	-19.67%	11.63%	-11.23%
本期基金份额净值增长率	-19.10%	11.86%	-9.89%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-205,999,563.47	102,554,545.44	-26,537,711.35
期末可供分配基金份额利润	-0.1335	0.0893	-0.0186
期末基金资产净值	1,337,394,446.88	1,251,515,493.75	1,403,077,081.55
期末基金份额净值	0.867	1.089	0.981
3.1.3 累	2018 年末	2017 年末	2016 年末

计期末指标			
基金份额累计净值增长率	-2.05%	21.08%	8.25%

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

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

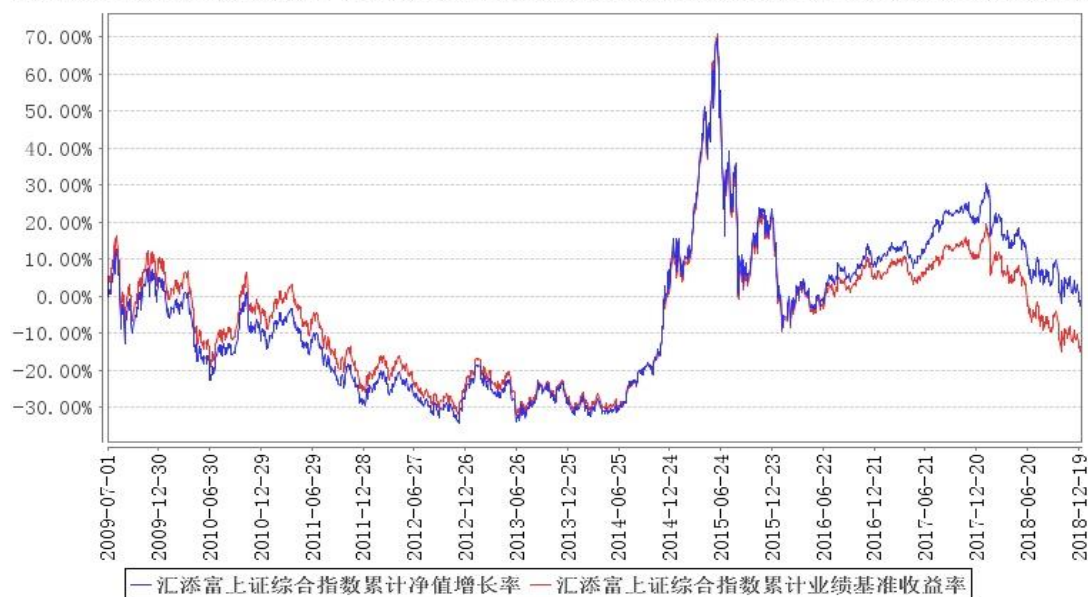
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-10.71%	1.40%	-11.02%	1.44%	0.31%	-0.04%
过去六个月	-8.64%	1.26%	-11.79%	1.29%	3.15%	-0.03%
过去一年	-19.10%	1.13%	-23.34%	1.17%	4.24%	-0.04%
过去三年	-18.46%	1.06%	-28.00%	1.08%	9.54%	-0.02%
过去五年	36.04%	1.44%	17.06%	1.41%	18.98%	0.03%
自基金合同生效起至今	-2.05%	1.36%	-14.76%	1.34%	12.71%	0.02%

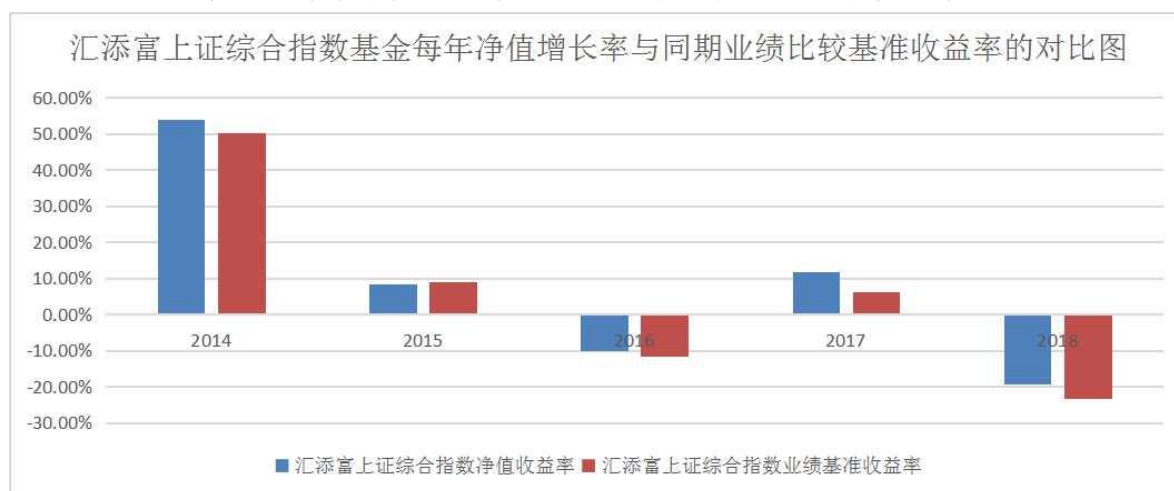
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富上证综合指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金建仓期为自《基金合同》生效之日(2009年7月1日)起3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

3.2.3 过去五年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



注:1、本基金的《基金合同》生效日为2009年7月1日。

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

单位:元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
----	-------------	----------	-----------	----------	----

2018 年	0.1800	10,502,847.91	8,810,776.99	19,313,624.90	-
2017 年	0.0800	5,696,623.93	4,829,336.79	10,525,960.72	-
2016 年	0.4000	32,030,990.71	26,470,828.38	58,501,819.09	-
合计	0.6600	48,230,462.55	40,110,942.16	88,341,404.71	-

§ 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 2018 年 12 月 31 日，汇添富资产管理总规模超过 6500 亿元，其中公募资产管理规模（剔除货基及短期理财债基）为 1738.78 亿元，稳居行业前十。优秀的产品及服务赢得了行业与市场的高度认可。2018 年，汇添富基金荣获“十大产品创新基金公司奖”“公募基金 20 年最佳主动权益基金管理人”“公募基金 20 年十大最佳基金管理人”“基金 20 年‘金基金’TOP 基金公司”“中国基金业 20 周年优秀基金管理公司（7-15 年组别）及管理层”等奖项，旗下多只基金荣获金牛奖、金基金奖、明星基金奖等奖项；“添富智投”荣获“上海金融创新奖”，“添富养老”荣获“综合奖·2018 中国 AI 金融先锋榜”等奖项。

2018 年，汇添富基金新成立 23 只公募基金，包括 13 只混合型基金，2 只股票型基金，2 只指数基金，6 只债券基金。新发重点主动权益产品包括添富价值创造定开混合、添富行业整合混合、添富智能制造股票、汇添富文体娱乐混合、添富创新医药混合、添富全球消费混合（QDII）等，有序推动不同久期、信用级别的债券产品落地，参与发售战略配售基金，探索养老目标日期 FOF 基金。2018 年底，公司公募基金产品总数达 120 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2018 年，汇添富基金进一步夯实自有平台基础建设，在全方位升级平台架构及安全系统的基

基础上，不断引领行业创新，规模及客户数均处于行业领先水平。全年实现指纹识别、人脸识别、常用设备保护、7*24 小时智能交易监控等重大升级；推出多款树立行业标杆的拳头功能：指数宝、理财日历、模拟组合、实时估值等。与此同时，互联网金融对外合作业务取得重大突破，与多家互联网巨头达成深度战略合作。截至年底，对外合作伙伴数量已超 110 家，成为业内对外合作最多的公司之一。

2018 年，汇添富基金持续推进大机构战略，机构业务规模保持较好的增长势头。公司深受专业机构投资者信任，获得所有大型银行及保险委外专户组合，且保险委托管理规模同业排名第一。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务规模快速增长，受托管理组合账户数量及规模持续增加。

2018 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。

2018 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。

2018 年，香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理继续发挥显著成效，国际业务总资产管理规模取得长足进步。公司海外产品线进一步完善，发行了 QDII 项下汇添富全球消费行业混合型证券投资基金；港股通项下添富沪港深大盘价值混合基金、添富沪港深优势定开基金。“港股通”类委外专户管理规模继续保持领先，海外主动管理权益资产规模保持行业前列。2018 年，香港子公司在加强母公司投研一体化基础上，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与五年的五星评级，根据彭博统计在最近三年、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和五年四星评级。

2018 年，汇添富公益事业坚持不懈，连续第十一年开展“河流·孩子”公益助学计划。继 2017 年公司党委下属的八个党支部和各地“添富小学”建立结对关系后，2018 年，各支部纷纷前往相应学校开展回访及支教活动。党员们经过实地探访，了解学校实际困难和发展需求，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，并通过向公司员工发售筹款台历、参加“99 公益日”筹款、参与“一个鸡蛋的暴走”等活动，全年筹款约 8 万余元，用于添富小学国学课程筹备及开设、教师培训项目开展、图书室扩充等。

2019 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

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）、汇添富中证 500 指数（LOF）、添富价值多因子股票的基金经理，指数与量化投资部副总监。	2010 年 2 月 5 日	-	12	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 5 日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金的基金经理，2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理，2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费 ETF 基金、中证医药卫生 ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金的基

					金经理，2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中指数基金的基金经理，2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理，2015 年 3 月 24 日至今任汇添富主要消费 ETF 联接基金的基金经理，2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理，2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理，2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗指数（LOF）的基金经理，2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数（LOF）的基金经理，2018 年 3 月 23 日至今任添富价值多因子股票的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 13 次，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2018 年，基本面角度，宏观经济保持韧性，但经济增长及企业盈利在边际上存在一定压力；政策面，去杠杆和金融强监管保持定力，有效降低了系统性风险，同时政策灵活性提高，下半年逆周期调控措施逐步出台，扶持民营企业、鼓励金融支持实体经济、进一步扩大改革开放、推进减税减费等一系列举措，边际上改善市场的风险偏好；中美经贸争端呈现长期性和复杂性，影响逐渐显现，成为市场的重要外生变量。

风格上，A 股进一步向成熟市场靠拢，基本面质地优良的股票存在较持续的超额收益，与此同时，盈利能力一般的部分中小市值股票流动性持续萎缩。相比 2017 年极致化的“二八分化”，2018 年不同风格、行业、个股的表现相对更加均衡，但部分事件对特定行业和个股的影响极大，如医药、“贸易战”相关板块和个股出现了较大的波动，风格和行业均衡配置的重要性继续加大。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位报告期内基本保持在 92%~95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。本基金对抽样复制组合继续采取缓冲式调整，降低了冗余的交易量。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内上综指基准下跌 23.34%，本基金在报告期内累计收益率为-19.10%，收益率超越业绩比较基准 4.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，经济基本面角度，国内经济增速下行压力仍然存在，货币、信用已趋于边际宽松，随着逆周期调节措施的加码，总体经济形势或将趋于平稳。政策方面，当前去杠杆、强监管、控风险措施初见成效，进一步深化改革开放，加大减税降费力度，激发企业活力等一系列改革措施可能成为经济发展的重要驱动力，从而边际上改善市场的风险偏好；中美博弈具有长期性和复杂性，随着美国自身经济形势和国内外环境的变化，可能出现一定进展，从而带来相对稳定的外部环境。

估值角度，当前 A 股处于历史低位，相比国外资本市场同样具有一定的吸引力，已经进入可以逐步配置的区间。资金面角度，随着资本市场进一步对外开放，海外资金大概率仍将持续流入 A 股；养老金、社保、保险等长期资金存在权益资产配置需求，A 股有进一步向成熟市场靠拢的可能性。风格角度，从基本面和增量资金偏好角度，质地优良、估值匹配度高的股票仍具有核心配置价值；行业角度，改革深化、减税降费、中美贸易争端均可能对一些行业的竞争格局产生影响，站在风控角度，保持风格和行业均衡的重要性进一步提高。

汇添富上证综指投资标的以大盘蓝筹标的为主，大概率受益于 A 股投资者结构变化趋势，同时风格行业相对均衡，是在市场底部区域逐步配置的良好标的。

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，通过合规法务、投资风控、稽核内审工作，加强公司经营与基金运作的合规性监察，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：

1、进一步提升合规法务管理工作

强化合规审核和风险把控，在业务日常推进中加强合规管理；为公司各项业务的进展和风险控制提供全面的法务数据和法律支持；强化对合规专职、兼职人员履职情况的日常管理，有效实现合规管理的下沉；开展形式多样的合规培训与教育，促进人员合规执业。

2、进一步完善投资风险控制工作

加强投资风险排查，推动公司内部风险评价体系建设；通过持续的系统建设以及人员专业能力提升，将风险管理工作向一线业务进一步下沉；有效实施投资交易监控，推动风险管理系统的优化及完善。

3、进一步加强稽核内审工作

通过日常风险排查与专项稽核，协助公司各业务条线尽早发现并控制合规风险；采取稽核监察措施，监督人员合规执业；通过协助监管机构检查工作和会计事务所审计工作，促进公司不断完善内部控制管理。

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，继续加强合规管理和风险控制，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《中国证监会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。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

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。

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。

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：每年度 6 月和 12 月的最后一个交易日每份基金份额可供分配利润超过 0.02 元时，至少将期末可供分配利润的 20% 进行收益分配。

本基金于 2018 年 1 月 18 日实施利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.18 元人民币。

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

本报告期内，本基金托管人在对汇添富上证综合指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，汇添富上证综合指数证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富上证综合指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富上证综合指数证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 19,313,624.9 元。

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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富上证综合指数证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 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（2019）审字第 60466941_B09 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	汇添富上证综合指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的汇添富上证综合指数证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表、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，后附的汇添富上证综合指数证券投资基金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，公允反映了汇添富上证综合指数证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度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，我们独立于汇添富上证综合指数证券投资基金，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	汇添富上证综合指数证券投资基金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。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。
管理层和治理层对财务报表的责任	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。 在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富上证综合指数证券投资基金的持续经营能力，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。 治理层负责监督汇添富上证综合指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： （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。 （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。

	(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。 (4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇添富上证综合指数证券投资基金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上证综合指数证券投资基金不能持续经营。 (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。 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。	
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	徐 艳	许培菁
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2019 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	75,897,341.59	65,661,717.87
结算备付金		—	—
存出保证金		48,612.21	88,976.35
交易性金融资产	7.4.7.2	1,263,930,379.16	1,187,810,854.34
其中：股票投资		1,263,773,379.16	1,187,250,096.24
基金投资		—	—
债券投资		157,000.00	560,758.10
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		—	—
应收利息	7.4.7.5	17,363.24	13,545.35

应收股利		-	-
应收申购款		1,563,426.33	324,435.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,341,457,122.53	1,253,899,529.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,315,515.40	-
应付赎回款		297,278.24	918,856.42
应付管理人报酬		863,314.05	797,405.31
应付托管费		172,662.79	159,481.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	33,295.38	127,826.15
应交税费		3.73	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	380,606.06	380,466.79
负债合计		4,062,675.65	2,384,035.74
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,543,394,010.35	1,148,960,948.31
未分配利润	7.4.7.10	-205,999,563.47	102,554,545.44
所有者权益合计		1,337,394,446.88	1,251,515,493.75
负债和所有者权益总计		1,341,457,122.53	1,253,899,529.49

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.867 元，基金份额总额 1,543,394,010.35 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-270,297,903.66	177,112,961.12
1. 利息收入		710,530.96	618,222.57
其中：存款利息收入	7.4.7.11	709,657.34	617,904.46

债券利息收入		873.62	318.11
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）		45,039,351.23	109,683,685.63
其中：股票投资收益	7.4.7.12	8,153,483.12	80,081,829.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	59,566.79	50,913.69
资产支持证券投资	7.4.7.13.1	-	-
收益			
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	36,826,301.32	29,550,942.21
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-316,681,658.54	66,437,628.19
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	633,872.69	373,424.73
减：二、费用		14,895,225.97	14,857,784.44
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	10,907,655.72	10,473,544.49
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,181,531.13	2,094,708.92
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,407,711.21	1,891,287.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1.91	-
7. 其他费用	7.4.7.20	398,326.00	398,244.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-285,193,129.63	162,255,176.68

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 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	1,148,960,948.31	102,554,545.44	1,251,515,493.75

权益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-285,193,129.63	-285,193,129.63
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)	394,433,062.04	-4,047,354.38	390,385,707.66
其中:1.基金申购款	1,003,550,388.98	4,760,093.33	1,008,310,482.31
2.基金赎回款	-609,117,326.94	-8,807,447.71	-617,924,774.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-19,313,624.90	-19,313,624.90
五、期末所有者权益(基金净值)	1,543,394,010.35	-205,999,563.47	1,337,394,446.88
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 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)	1,429,614,792.90	-26,537,711.35	1,403,077,081.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	162,255,176.68	162,255,176.68
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)	-280,653,844.59	-22,636,959.17	-303,290,803.76
其中:1.基金申购款	297,354,606.04	14,309,718.31	311,664,324.35
2.基金赎回款	-578,008,450.63	-36,946,677.48	-614,955,128.11
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)	-	-10,525,960.72	-10,525,960.72

减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	1,148,960,948.31	102,554,545.44	1,251,515,493.75

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：

张晖

基金管理人负责人

李骁

主管会计工作负责人

雷青松

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富上证综合指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]371 号文《关于核准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的批复》的核准，由汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开发行募集，基金合同于 2009 年 7 月 1 日正式生效，首次设立募集规模为 9,097,758,651.47 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括上海证券交易所上市交易的所有股票、新股(如一级市场初次发行或增发)等。如以后法律法规及中国证监会允许基金投资其他金融工具，如股指期货、ETF 等，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定，将其纳入投资范围。本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。本基金的业绩比较基准为：上证综合指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度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。

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和债券投资等；

(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，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和托管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) 本基金每一基金份额享有同等分配权；

(2) 收益分配时所发生的银行转帐或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转帐或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额；

(3) 本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次至少将可供分配利润的 20% 进行收益分配；

(4) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(5) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值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；

(6) 在符合上述基金收益分配的前提下，每年度 6 月和 12 月的最后一个交易日每份基金份额可供分配利润超过 0.02 元时，至少将期末可供分配利润的 20% 进行收益分配，且在收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）之后的 15 个工作日之内完成；

(7) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(8) 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，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

7.4.6.4 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。

7.4.6.5 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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	75,897,341.59	65,661,717.87
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月及以上	-	-
其他存款	-	-
合计	75,897,341.59	65,661,717.87

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,482,845,935.87	1,263,773,379.16	-219,072,556.71
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	157,000.00	157,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	157,000.00	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,483,002,935.87	1,263,930,379.16	-219,072,556.71
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,089,678,752.51	1,187,250,096.24	97,571,343.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	523,000.00	560,758.10
	银行间市场	-	-
	合计	523,000.00	37,758.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,090,201,752.51	1,187,810,854.34	97,609,101.83

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

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：本基金本报告期末及上年度末均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：本基金本报告期末及上年度末均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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	17,331.70	13,369.05
应收定期存款利息	—	—
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	—	—
应收债券利息	9.64	136.30
应收资产支持证券利息	—	—
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	21.90	40.00
合计	17,363.24	13,545.35

注：“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	33,295.38	127,826.15
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	33,295.38	127,826.15

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	606.06	466.79
应付信息披露费	300,000.00	300,000.00
应付审计费	80,000.00	80,000.00
合计	380,606.06	380,466.79

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,148,960,948.31	1,148,960,948.31
本期申购	1,003,550,388.98	1,003,550,388.98
本期赎回（以“-”号填列）	-609,117,326.94	-609,117,326.94
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,543,394,010.35	1,543,394,010.35

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	375,293,605.27	-272,739,059.83	102,554,545.44
本期利润	31,488,528.91	-316,681,658.54	-285,193,129.63
本期基金份额交易产生的变动数	125,430,183.85	-129,477,538.23	-4,047,354.38
其中：基金申购款	327,058,625.52	-322,298,532.19	4,760,093.33
基金赎回款	-201,628,441.67	192,820,993.96	-8,807,447.71
本期已分配利润	-19,313,624.90	-	-19,313,624.90
本期末	512,898,693.13	-718,898,256.60	-205,999,563.47

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	679,612.83	610,194.71
定期存款利息收入	-	-

其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	12,692.80	4,631.32
其他	17,351.71	3,078.43
合计	709,657.34	617,904.46

注：“其他”为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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	334,573,434.69	718,073,727.63
减：卖出股票成本总额	326,419,951.57	637,991,897.90
买卖股票差价收入	8,153,483.12	80,081,829.73

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,496,583.80	1,710,095.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,436,000.00	1,659,000.00
减：应收利息总额	1,017.01	181.81
买卖债券差价收入	59,566.79	50,913.69

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	36,826,301.32	29,550,942.21
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	36,826,301.32	29,550,942.21

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-316,681,658.54	66,437,628.19
股票投资	-316,643,900.44	66,399,870.09
债券投资	-37,758.10	37,758.10
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-316,681,658.54	66,437,628.19

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	633,872.69	373,424.73
合计	633,872.69	373,424.73

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,407,711.21	1,891,287.03
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,407,711.21	1,891,287.03

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	326.00	244.00
合计	398,326.00	398,244.00

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

根据中国证监会[2017]13 号公告《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的有关规定，经与基金托管人协商一致，本基金的管理人决定自 2019 年 2 月 14 日起，对本基金持有的停牌股票信威集团（代码：600485）按照 5.76 元进行估值，由此减少交易性金融资产账面价值及公允价值变动收益人民币 432,205.13 元。

截至财务报表批准日，除上述估值变更事项外，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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
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
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资产管理（香港）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：以下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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
东方证券	764,769,921.38	72.69	1,154,039,204.33	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
东方证券	1,496,583.80	100.00	1,710,095.50	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 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 (%)
东方证券	712,225.29	72.69	33,295.38	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 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 (%)
东方证券	1,074,755.91	100.00	127,826.15	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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,907,655.72	10,473,544.49
其中：支付销售机构的客户维护费	1,739,710.10	2,154,607.23

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,181,531.13	2,094,708.92

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 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、公休日等，支付日期顺延。

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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及上年度末均未投资本基金。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	75,897,341.59	679,612.83	65,661,717.87	610,194.71

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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

单位：人民币元

序号	权益 登记日	场内除 息日	场外 除息 日	每 10 份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2018 年 01 月 18 日	-	2019 年 01 月 18 日	0.1800	10,502,847.91	8,810,776.99	19,313,624.90	-
合计	-	-	-	0.1800	10,502,847.91	8,810,776.99	19,313,624.90	-

7.4.12 期末(2018 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
601860	紫金 银行	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 3 日	新股流 通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券	证券	成功	可流通	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总	备注

代码	名称	认购日	日	限类型	价格	值单价	(单位: 张)	成本总额	额	
110049	海尔转债	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 18 日	新债流通受限	100.00	100.00	1,570	157,000.00	157,000.00	-

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
600030	中信证券	2018 年 12 月 25 日	重大事项停牌	16.01	2019 年 1 月 10 日	17.15	496,000	9,356,136.99	7,940,960.00	-
600270	外运发展	2018 年 12 月 13 日	重大事项停牌	20.99	-	-	67,800	1,224,904.65	1,423,122.00	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大资产重组停牌	10.03	-	-	101,219	3,187,718.99	1,015,226.57	-

注：外运发展已于 2018 年 12 月 21 日获得上交所出具的《关于中外运空运发展股份有限公司股票终止上市的决定》，并于 2018 年 12 月 28 日终止上市。外运发展终止上市后，换股股权登记日收市后登记在册的除中国外运以外的全体股东可按照公告方案进行换股。

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 2018 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 2018 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、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 2018 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	75,897,341.59	-	-	-	-	-	75,897,341.59
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	48,612.21	-	-	-	-	-	48,612.21
交易性金融资产	-	-	157,000.00	-	-	1,263,773.379.16	1,263,930.379.16
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	-	-	17,363.24	17,363.24
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	282,359.18	-	-	-	-	1,281,067.15	1,563,426.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	76,228,312.98	-	157,000.00	-	-	1,265,071,809.55	1,341,457,122.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	297,278.24	297,278.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	863,314.05	863,314.05
应付托管费	-	-	-	-	-	172,662.79	172,662.79
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,315,515.40	2,315,515.40
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易	-	-	-	-	-	33,295.38	33,295.38

费用							
应付 税费	-	-	-	-	-	3.73	3.73
应付 利息	-	-	-	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	380,606.06	380,606.06
负债 总计	-	-	-	-	-	4,062,675.65	4,062,675.65
利率 敏感 度缺 口	76,228,312.98	-	157,000.00	-	-	1,261,009,133.90	1,337,394,446.88
上 年 度 末 201 7 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行 存款	65,661,717.87	-	-	-	-	-	65,661,717.87
结算 备付 金	-	-	-	-	-	-	-
存出 保证 金	88,976.35	-	-	-	-	-	88,976.35
交易 性金 融资 产	-	-	560,758.10	-	-	1,187,250,096.24	1,187,810,854.34
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
应收 利息	-	-	-	-	-	13,545.35	13,545.35

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	101,039.50	-	-	-	-	223,396.08	324,435.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	65,851,733.72	-	560,758.10	-	-	1,187,487,037.67	1,253,899,529.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	918,856.42	918,856.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	797,405.31	797,405.31
应付托管费	-	-	-	-	-	159,481.07	159,481.07
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	127,826.15	127,826.15
应付	-	-	-	-	-	-	-

税费							
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	380,466.79	380,466.79
负债总计	-	-	-	-	-	2,384,035.74	2,384,035.74
利率敏感 度缺口	65,851,733.72	-	560,758.10	-	-	1,185,103,001.93	1,251,515,493.75

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，本基金本报告期末及上年度末计息资产仅包括银行存款、存出保证金及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

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 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,263,773,379.16	94.50	1,187,250,096.24	94.86
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	157,000.00	0.01	560,758.10	0.04
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,263,930,379.16	94.51	1,187,810,854.34	94.91

注：本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 90%-95%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；投资于标的指数成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
分析	上证综合指数上涨 5%	61,419,849.85	56,057,565.76
	上证综合指数下跌 5%	-61,419,849.85	-56,057,565.76

注：本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价

格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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 2018 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 1,253,343,924.79 元，属于第二层次的余额为人民币 10,586,454.37 元，无划分为第三层次余额（于 2017 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 1,164,599,977.41 元，属于第二层次的余额为人民币 23,210,876.93 元，无划分为第三层次余额）。

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 2019 年 3 月 20 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	1,263,773,379.16	94.21
	其中：股票	1,263,773,379.16	94.21
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	157,000.00	0.01
	其中：债券	157,000.00	0.01
	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	75,897,341.59	5.66
8	其他各项资产	1,629,401.78	0.12
9	合计	1,341,457,122.53	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,077,648.23	0.16
B	采矿业	138,963,951.81	10.39
C	制造业	386,507,494.43	28.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	62,056,311.41	4.64
E	建筑业	50,398,894.57	3.77
F	批发和零售业	37,514,629.83	2.81
G	交通运输、仓储和邮政业	59,278,935.71	4.43
H	住宿和餐饮业	2,934,144.72	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,156,170.47	1.66
J	金融业	419,991,353.15	31.40
K	房地产业	44,352,622.62	3.32
L	租赁和商务服务业	9,952,984.09	0.74
M	科学研究和技术服务业	2,990,777.81	0.22
N	水利、环境和公共	2,720,208.10	0.20

	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	14,616,248.06	1.09
S	综合	5,681,012.64	0.42
	合计	1,262,193,387.65	94.38

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	106,723.71	0.01
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	1,423,122.00	0.11
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	50,145.80	0.00
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	1,579,991.51	0.12

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	19,523,206	70,283,541.60	5.26
2	601857	中国石油	8,278,657	59,689,116.97	4.46
3	601988	中国银行	14,871,611	53,686,515.71	4.01
4	600036	招商银行	1,715,615	43,233,498.00	3.23
5	600519	贵州茅台	66,177	39,045,091.77	2.92
6	601318	中国平安	554,290	31,095,669.00	2.33
7	601328	交通银行	4,672,517	27,053,873.43	2.02
8	600028	中国石化	4,891,677	24,702,968.85	1.85
9	601628	中国人寿	1,069,571	21,808,552.69	1.63
10	601939	建设银行	2,895,511	18,444,405.07	1.38
11	600900	长江电力	1,123,958	17,848,453.04	1.33
12	600104	上汽集团	598,799	15,969,969.33	1.19
13	601166	兴业银行	1,067,535	15,948,972.90	1.19
14	601088	中国神华	845,815	15,190,837.40	1.14
15	600000	浦发银行	1,442,192	14,133,481.60	1.06
16	601668	中国建筑	2,174,085	12,392,284.50	0.93
17	601766	中国中车	1,260,761	11,372,064.22	0.85
18	600016	民生银行	1,835,108	10,515,168.84	0.79
19	600276	恒瑞医药	190,790	10,064,172.50	0.75
20	603288	海天味业	141,875	9,761,000.00	0.73
21	601998	中信银行	1,773,972	9,668,147.40	0.72
22	601601	中国太保	330,078	9,384,117.54	0.70
23	601225	陕西煤业	1,138,381	8,469,554.64	0.63
24	600030	中信证券	496,000	7,940,960.00	0.59
25	601688	华泰证券	482,860	7,822,332.00	0.58
26	601818	光大银行	2,068,567	7,653,697.90	0.57
27	600019	宝钢股份	1,150,255	7,476,657.50	0.56
28	600048	保利地产	619,168	7,299,990.72	0.55
29	600887	伊利股份	317,161	7,256,643.68	0.54
30	601800	中国交建	612,139	6,892,685.14	0.52
31	600050	中国联通	1,301,576	6,729,147.92	0.50
32	601390	中国中铁	956,228	6,684,033.72	0.50
33	601186	中国铁建	597,759	6,497,640.33	0.49
34	601006	大秦铁路	771,344	6,348,161.12	0.47
35	601888	中国国旅	105,284	6,338,096.80	0.47
36	601229	上海银行	566,105	6,334,714.95	0.47
37	600018	上港集团	1,205,379	6,243,863.22	0.47

38	600585	海螺水泥	208,481	6,104,323.68	0.46
39	601211	国泰君安	390,400	5,980,928.00	0.45
40	600009	上海机场	105,162	5,338,023.12	0.40
41	601169	北京银行	947,672	5,316,439.92	0.40
42	600031	三一重工	631,994	5,270,829.96	0.39
43	600015	华夏银行	666,881	4,928,250.59	0.37
44	601336	新华保险	110,855	4,682,515.20	0.35
45	601989	中国重工	1,099,929	4,674,698.25	0.35
46	600690	青岛海尔	328,800	4,553,880.00	0.34
47	601985	中国核电	808,600	4,261,322.00	0.32
48	600271	航天信息	183,524	4,200,864.36	0.31
49	600011	华能国际	546,096	4,030,188.48	0.30
50	601117	中国化学	746,327	4,000,312.72	0.30
51	601111	中国国航	521,081	3,981,058.84	0.30
52	600999	招商证券	296,597	3,974,399.80	0.30
53	600340	华夏幸福	155,436	3,955,846.20	0.30
54	601933	永辉超市	493,601	3,884,639.87	0.29
55	600606	绿地控股	634,188	3,874,888.68	0.29
56	601669	中国电建	797,083	3,873,823.38	0.29
57	600188	兖州煤业	426,683	3,746,276.74	0.28
58	600837	海通证券	421,586	3,709,956.80	0.28
59	601238	广汽集团	355,556	3,658,671.24	0.27
60	600089	特变电工	535,119	3,633,458.01	0.27
61	600919	江苏银行	602,200	3,595,134.00	0.27
62	600516	方大炭素	209,003	3,492,440.13	0.26
63	600010	包钢股份	2,359,380	3,491,882.40	0.26
64	603993	洛阳钼业	914,539	3,438,666.64	0.26
65	600023	浙能电力	707,279	3,345,429.67	0.25
66	600436	片仔癀	35,338	3,062,037.70	0.23
67	600153	建发股份	432,595	3,049,794.75	0.23
68	600741	华域汽车	164,950	3,035,080.00	0.23
69	600309	万华化学	108,011	3,023,227.89	0.23
70	600332	白云山	84,265	3,013,316.40	0.23
71	601899	紫金矿业	897,042	2,996,120.28	0.22
72	600183	生益科技	294,753	2,965,215.18	0.22
73	601155	新城控股	123,600	2,928,084.00	0.22
74	600886	国投电力	361,705	2,911,725.25	0.22
75	600547	山东黄金	96,119	2,907,599.75	0.22
76	601618	中国中冶	925,459	2,878,177.49	0.22
77	601877	正泰电器	117,462	2,847,278.88	0.21
78	601009	南京银行	438,776	2,834,492.96	0.21
79	600161	天坛生物	127,937	2,718,661.25	0.20

80	601012	隆基股份	154,289	2,690,800.16	0.20
81	601727	上海电气	538,692	2,661,138.48	0.20
82	600549	厦门钨业	216,601	2,616,540.08	0.20
83	600795	国电电力	1,005,928	2,575,175.68	0.19
84	601098	中南传媒	201,256	2,515,700.00	0.19
85	600660	福耀玻璃	109,630	2,497,371.40	0.19
86	601100	恒立液压	125,135	2,478,924.35	0.19
87	600406	国电南瑞	133,202	2,468,233.06	0.18
88	600967	内蒙一机	236,182	2,456,292.80	0.18
89	600196	复星医药	105,391	2,452,448.57	0.18
90	600115	东方航空	512,326	2,433,548.50	0.18
91	600201	生物股份	145,946	2,422,703.60	0.18
92	600029	南方航空	364,841	2,422,544.24	0.18
93	600703	三安光电	213,754	2,417,557.74	0.18
94	600350	山东高速	527,537	2,405,568.72	0.18
95	600383	金地集团	247,131	2,377,400.22	0.18
96	600518	康美药业	258,063	2,376,760.23	0.18
97	600893	航发动力	106,252	2,307,793.44	0.17
98	601881	中国银河	337,604	2,302,459.28	0.17
99	601018	宁波港	683,974	2,284,473.16	0.17
100	603338	浙江鼎力	40,527	2,282,480.64	0.17
101	601901	方正证券	427,400	2,269,494.00	0.17
102	600588	用友网络	106,010	2,258,013.00	0.17
103	600511	国药股份	96,820	2,251,065.00	0.17
104	601898	中煤能源	471,087	2,190,554.55	0.16
105	601231	环旭电子	235,778	2,122,002.00	0.16
106	600529	山东药玻	110,417	2,097,923.00	0.16
107	600027	华电国际	441,375	2,096,531.25	0.16
108	600085	同仁堂	76,054	2,091,485.00	0.16
109	603160	汇顶科技	26,503	2,085,786.10	0.16
110	600482	中国动力	93,400	2,080,018.00	0.16
111	600705	中航资本	489,856	2,076,989.44	0.16
112	600398	海澜之家	244,295	2,071,621.60	0.15
113	600926	杭州银行	279,480	2,068,152.00	0.15
114	600098	广州发展	364,157	2,061,128.62	0.15
115	600346	恒力股份	154,121	2,042,103.25	0.15
116	600377	宁沪高速	206,410	2,022,818.00	0.15
117	600810	神马股份	197,064	1,986,405.12	0.15
118	600688	上海石化	397,694	1,984,493.06	0.15
119	600674	川投能源	227,800	1,975,026.00	0.15
120	600637	东方明珠	192,769	1,973,954.56	0.15
121	600612	老凤祥	43,102	1,939,590.00	0.15

122	601866	中远海发	834,692	1,903,097.76	0.14
123	603833	欧派家居	23,403	1,865,687.16	0.14
124	600176	中国巨石	192,926	1,865,594.42	0.14
125	601633	长城汽车	330,025	1,848,140.00	0.14
126	600487	亨通光电	107,579	1,834,221.95	0.14
127	600323	瀚蓝环境	128,192	1,798,533.76	0.13
128	601607	上海医药	105,397	1,791,749.00	0.13
129	601788	光大证券	204,238	1,791,167.26	0.13
130	600809	山西汾酒	50,926	1,784,956.30	0.13
131	600438	通威股份	215,185	1,781,731.80	0.13
132	600236	桂冠电力	316,598	1,779,280.76	0.13
133	600649	城投控股	323,525	1,769,681.75	0.13
134	600570	恒生电子	33,960	1,765,240.80	0.13
135	600282	南钢股份	514,500	1,759,590.00	0.13
136	600663	陆家嘴	133,535	1,734,619.65	0.13
137	600111	北方稀土	197,687	1,733,714.99	0.13
138	601991	大唐发电	544,741	1,715,934.15	0.13
139	600061	国投资本	190,803	1,715,318.97	0.13
140	600352	浙江龙盛	176,422	1,702,472.30	0.13
141	600593	大连圣亚	63,720	1,687,942.80	0.13
142	601600	中国铝业	475,465	1,687,900.75	0.13
143	600299	安迪苏	146,000	1,676,080.00	0.13
144	600535	天士力	87,030	1,670,976.00	0.12
145	600498	烽火通信	58,248	1,658,320.56	0.12
146	601919	中远海控	410,429	1,658,133.16	0.12
147	600297	广汇汽车	408,201	1,657,296.06	0.12
148	603606	东方电缆	184,540	1,647,942.20	0.12
149	600489	中金黄金	188,543	1,617,698.94	0.12
150	600260	凯乐科技	94,900	1,610,453.00	0.12
151	601377	兴业证券	344,706	1,599,435.84	0.12
152	600068	葛洲坝	252,119	1,593,392.08	0.12
153	601992	金隅集团	452,562	1,583,967.00	0.12
154	601177	杭齿前进	173,680	1,559,646.40	0.12
155	601339	百隆东方	276,200	1,527,386.00	0.11
156	600566	济川药业	45,500	1,525,615.00	0.11
157	600362	江西铜业	114,732	1,509,873.12	0.11
158	600867	通化东宝	108,347	1,506,023.30	0.11
159	600461	洪城水业	272,500	1,498,750.00	0.11
160	600675	中华企业	265,296	1,480,351.68	0.11
161	600233	圆通速递	146,600	1,466,000.00	0.11
162	600745	闻泰科技	68,900	1,455,857.00	0.11
163	600977	中国电影	101,500	1,453,480.00	0.11

164	603799	华友钴业	48,204	1,451,422.44	0.11
165	600170	上海建工	477,551	1,446,979.53	0.11
166	601198	东兴证券	150,497	1,438,751.32	0.11
167	601021	春秋航空	45,201	1,437,843.81	0.11
168	600064	南京高科	181,840	1,432,899.20	0.11
169	600390	五矿资本	204,000	1,419,840.00	0.11
170	600600	青岛啤酒	40,355	1,406,775.30	0.11
171	603508	思维列控	35,302	1,405,372.62	0.11
172	600177	雅戈尔	194,522	1,398,613.18	0.10
173	600757	长江传媒	213,607	1,392,717.64	0.10
174	601808	中海油服	162,097	1,384,308.38	0.10
175	600256	广汇能源	367,046	1,380,092.96	0.10
176	601158	重庆水务	247,464	1,375,899.84	0.10
177	600219	南山铝业	650,249	1,372,025.39	0.10
178	603018	中设集团	78,324	1,364,404.08	0.10
179	600066	宇通客车	114,699	1,359,183.15	0.10
180	601997	贵阳银行	126,800	1,354,224.00	0.10
181	600208	新湖中宝	466,710	1,353,459.00	0.10
182	600658	电子城	220,664	1,348,257.04	0.10
183	601228	广州港	339,275	1,343,529.00	0.10
184	600825	新华传媒	272,678	1,336,122.20	0.10
185	600510	黑牡丹	218,181	1,322,176.86	0.10
186	600522	中天科技	162,173	1,321,709.95	0.10
187	600998	九州通	90,483	1,321,051.80	0.10
188	600729	重庆百货	46,674	1,320,874.20	0.10
189	600633	浙数文化	161,396	1,315,377.40	0.10
190	603025	大豪科技	117,460	1,309,679.00	0.10
191	600835	上海机电	89,663	1,304,596.65	0.10
192	601127	小康股份	76,000	1,302,640.00	0.10
193	600750	江中药业	76,882	1,301,612.26	0.10
194	600816	安信信托	297,702	1,300,957.74	0.10
195	603989	艾华集团	64,461	1,298,244.54	0.10
196	600895	张江高科	85,892	1,284,085.40	0.10
197	600273	嘉化能源	142,300	1,279,277.00	0.10
198	600038	中直股份	34,204	1,277,861.44	0.10
199	601878	浙商证券	175,098	1,271,211.48	0.10
200	600528	中铁工业	121,008	1,270,584.00	0.10
201	600448	华纺股份	262,900	1,264,549.00	0.09
202	600811	东方集团	344,452	1,260,694.32	0.09
203	600073	上海梅林	168,300	1,253,835.00	0.09
204	603167	渤海轮渡	142,904	1,251,839.04	0.09
205	600790	轻纺城	342,180	1,248,957.00	0.09

206	600699	均胜电子	53,300	1,245,088.00	0.09
207	600372	中航电子	95,409	1,238,408.82	0.09
208	600850	华东电脑	78,500	1,237,945.00	0.09
209	600062	华润双鹤	102,233	1,235,996.97	0.09
210	600559	老白干酒	99,988	1,235,851.68	0.09
211	600057	厦门象屿	295,383	1,234,700.94	0.09
212	603393	新天然气	40,401	1,232,230.50	0.09
213	601636	旗滨集团	324,100	1,231,580.00	0.09
214	603726	朗迪集团	65,639	1,224,823.74	0.09
215	601579	会稽山	136,500	1,213,485.00	0.09
216	600283	钱江水利	108,300	1,212,960.00	0.09
217	600665	天地源	351,893	1,210,511.92	0.09
218	600168	武汉控股	209,100	1,202,325.00	0.09
219	600642	申能股份	246,280	1,201,846.40	0.09
220	601107	四川成渝	342,525	1,191,987.00	0.09
221	600400	红豆股份	317,260	1,189,725.00	0.09
222	600128	弘业股份	150,205	1,189,623.60	0.09
223	600848	上海临港	57,500	1,189,100.00	0.09
224	600312	平高电气	146,973	1,187,541.84	0.09
225	600615	丰华股份	112,700	1,181,096.00	0.09
226	600351	亚宝药业	209,391	1,178,871.33	0.09
227	600873	梅花生物	279,131	1,177,932.82	0.09
228	600109	国金证券	164,470	1,177,605.20	0.09
229	600583	海油工程	240,320	1,177,568.00	0.09
230	600597	光明乳业	140,696	1,176,218.56	0.09
231	600229	城市传媒	174,300	1,171,296.00	0.09
232	600839	四川长虹	506,293	1,169,536.83	0.09
233	600641	万业企业	128,400	1,165,872.00	0.09
234	600020	中原高速	317,401	1,164,861.67	0.09
235	600221	海航控股	619,460	1,164,584.80	0.09
236	600987	航民股份	142,200	1,163,196.00	0.09
237	603663	三祥新材	68,300	1,161,100.00	0.09
238	601212	白银有色	393,000	1,159,350.00	0.09
239	600118	中国卫星	66,905	1,158,794.60	0.09
240	601900	南方传媒	136,797	1,151,830.74	0.09
241	600100	同方股份	116,822	1,136,678.06	0.08
242	600345	长江通信	50,900	1,132,016.00	0.08
243	600479	千金药业	145,740	1,130,942.40	0.08
244	600982	宁波热电	339,500	1,130,535.00	0.08
245	600808	马钢股份	326,030	1,128,063.80	0.08
246	600488	天药股份	299,800	1,118,254.00	0.08
247	600368	五洲交通	363,060	1,114,594.20	0.08

248	600694	大商股份	46,022	1,113,272.18	0.08
249	601928	凤凰传媒	140,085	1,112,274.90	0.08
250	603077	和邦生物	685,815	1,111,020.30	0.08
251	601677	明泰铝业	126,198	1,109,280.42	0.08
252	601699	潞安环能	166,505	1,108,923.30	0.08
253	600708	光明地产	317,060	1,106,539.40	0.08
254	600409	三友化工	193,326	1,105,824.72	0.08
255	601007	金陵饭店	136,800	1,103,976.00	0.08
256	601678	滨化股份	261,514	1,103,589.08	0.08
257	600004	白云机场	109,705	1,102,535.25	0.08
258	603779	威龙股份	83,200	1,102,400.00	0.08
259	601555	东吴证券	164,392	1,101,426.40	0.08
260	600339	中油工程	302,000	1,096,260.00	0.08
261	600577	精达股份	368,860	1,095,514.20	0.08
262	600697	欧亚集团	59,200	1,088,688.00	0.08
263	601518	吉林高速	421,156	1,086,582.48	0.08
264	600668	尖峰集团	91,400	1,078,520.00	0.08
265	600315	上海家化	39,500	1,078,350.00	0.08
266	600704	物产中大	234,092	1,072,141.36	0.08
267	600369	西南证券	306,778	1,067,587.44	0.08
268	600578	京能电力	363,711	1,065,673.23	0.08
269	600308	华泰股份	244,725	1,064,553.75	0.08
270	601811	新华文轩	113,600	1,057,616.00	0.08
271	600455	博通股份	48,005	1,055,629.95	0.08
272	603515	欧普照明	37,701	1,050,726.87	0.08
273	603100	川仪股份	139,378	1,048,122.56	0.08
274	603979	金诚信	139,800	1,047,102.00	0.08
275	600210	紫江企业	287,237	1,045,542.68	0.08
276	603589	口子窖	29,775	1,044,209.25	0.08
277	601188	龙江交通	351,700	1,041,032.00	0.08
278	601958	金钼股份	174,435	1,032,655.20	0.08
279	600603	广汇物流	252,640	1,030,771.20	0.08
280	601872	招商轮船	279,208	1,030,277.52	0.08
281	600327	大东方	250,016	1,030,065.92	0.08
282	600820	隧道股份	164,290	1,028,455.40	0.08
283	600573	惠泉啤酒	163,200	1,026,528.00	0.08
284	603306	华懋科技	71,705	1,021,796.25	0.08
285	600088	中视传媒	122,572	1,021,024.76	0.08
286	601199	江南水务	286,494	1,019,918.64	0.08
287	600376	首开股份	141,441	1,016,960.79	0.08
288	600485	信威集团	101,219	1,015,226.57	0.08
289	600090	同济堂	185,390	1,008,521.60	0.08

290	600497	驰宏锌锗	244,285	1,001,568.50	0.07
291	600106	重庆路桥	329,416	998,130.48	0.07
292	600973	宝胜股份	275,000	995,500.00	0.07
293	600373	中文传媒	76,362	993,469.62	0.07
294	600862	中航高科	177,397	993,423.20	0.07
295	603599	广信股份	94,500	992,250.00	0.07
296	600415	小商品城	283,473	989,320.77	0.07
297	600160	巨化股份	149,029	988,062.27	0.07
298	600713	南京医药	231,596	986,598.96	0.07
299	600885	宏发股份	43,381	978,675.36	0.07
300	603816	顾家家居	21,700	976,500.00	0.07
301	600858	银座股份	197,400	975,156.00	0.07
302	601333	广深铁路	307,551	971,861.16	0.07
303	603869	新智认知	64,600	971,584.00	0.07
304	600333	长春燃气	173,609	970,474.31	0.07
305	600080	金花股份	135,494	970,137.04	0.07
306	600287	江苏舜天	198,800	964,180.00	0.07
307	600819	耀皮玻璃	235,300	962,377.00	0.07
308	600796	钱江生化	185,882	961,009.94	0.07
309	603159	上海亚虹	54,200	960,966.00	0.07
310	600853	龙建股份	277,570	960,392.20	0.07
311	600021	上海电力	118,566	960,384.60	0.07
312	603698	航天工程	67,006	960,195.98	0.07
313	600325	华发股份	154,762	959,524.40	0.07
314	600628	新世界	151,185	958,512.90	0.07
315	600279	重庆港九	245,000	957,950.00	0.07
316	601118	海南橡胶	213,287	957,658.63	0.07
317	600361	华联综超	281,789	955,264.71	0.07
318	601137	博威合金	140,000	954,800.00	0.07
319	600300	维维股份	337,690	952,285.80	0.07
320	600561	江西长运	174,500	949,280.00	0.07
321	600452	涪陵电力	59,779	947,497.15	0.07
322	600410	华胜天成	161,300	945,218.00	0.07
323	603225	新凤鸣	50,404	945,075.00	0.07
324	600909	华安证券	199,300	940,696.00	0.07
325	600586	金晶科技	332,198	940,120.34	0.07
326	600449	宁夏建材	127,200	937,464.00	0.07
327	600336	澳柯玛	276,982	933,429.34	0.07
328	601611	中国核建	142,800	932,484.00	0.07
329	601179	中国西电	277,119	931,119.84	0.07
330	600823	世茂股份	247,380	930,148.80	0.07
331	600984	建设机械	182,280	924,159.60	0.07

332	603001	奥康国际	91,300	923,043.00	0.07
333	600754	锦江股份	43,272	921,693.60	0.07
334	603919	金徽酒	78,900	921,552.00	0.07
335	601099	太平洋	369,637	920,396.13	0.07
336	600971	恒源煤电	163,455	920,251.65	0.07
337	600022	山东钢铁	583,618	916,280.26	0.07
338	601599	鹿港文化	293,123	914,543.76	0.07
339	600676	交运股份	211,800	912,858.00	0.07
340	600167	联美控股	100,800	911,232.00	0.07
341	601216	君正集团	347,750	911,105.00	0.07
342	603898	好莱客	59,300	909,069.00	0.07
343	600589	广东榕泰	222,700	908,616.00	0.07
344	600258	首旅酒店	56,922	908,475.12	0.07
345	600356	恒丰纸业	165,404	908,067.96	0.07
346	601126	四方股份	177,800	905,002.00	0.07
347	600008	首创股份	263,300	903,119.00	0.07
348	601966	玲珑轮胎	66,100	902,265.00	0.07
349	603008	喜临门	97,600	899,872.00	0.07
350	600976	健民集团	62,800	896,784.00	0.07
351	600114	东睦股份	142,788	895,280.76	0.07
352	600664	哈药股份	226,056	892,921.20	0.07
353	600618	氯碱化工	137,000	889,130.00	0.07
354	600640	号百控股	90,300	885,843.00	0.07
355	600180	瑞茂通	125,296	883,336.80	0.07
356	600739	辽宁成大	84,148	880,188.08	0.07
357	600784	鲁银投资	172,400	872,344.00	0.07
358	600875	东方电气	110,399	871,048.11	0.07
359	600382	广东明珠	112,300	866,956.00	0.06
360	603020	爱普股份	116,600	866,338.00	0.06
361	600527	江南高纤	431,904	863,808.00	0.06
362	600127	金健米业	299,600	853,860.00	0.06
363	600126	杭钢股份	188,650	850,811.50	0.06
364	603788	宁波高发	58,623	847,102.35	0.06
365	601616	广电电气	266,434	844,595.78	0.06
366	600392	盛和资源	98,094	844,589.34	0.06
367	600502	安徽水利	235,640	838,878.40	0.06
368	600854	春兰股份	240,200	835,896.00	0.06
369	600375	华菱星马	236,200	831,424.00	0.06
370	603118	共进股份	131,800	830,340.00	0.06
371	601218	吉鑫科技	365,272	829,167.44	0.06
372	603090	宏盛股份	63,800	828,124.00	0.06
373	600598	北大荒	96,495	825,997.20	0.06

374	600203	福日电子	189,600	824,760.00	0.06
375	600623	华谊集团	101,700	821,736.00	0.06
376	600884	杉杉股份	63,293	817,745.56	0.06
377	600673	东阳光科	112,152	816,466.56	0.06
378	600731	湖南海利	193,400	816,148.00	0.06
379	600718	东软集团	69,592	803,787.60	0.06
380	603766	隆鑫通用	196,392	803,243.28	0.06
381	600218	全柴动力	178,400	802,800.00	0.06
382	600348	阳泉煤业	158,607	799,379.28	0.06
383	600742	一汽富维	79,894	797,342.12	0.06
384	600268	国电南自	188,029	797,242.96	0.06
385	601718	际华集团	237,978	797,226.30	0.06
386	600879	航天电子	147,200	796,352.00	0.06
387	600966	博汇纸业	252,877	794,033.78	0.06
388	600317	营口港	350,474	792,071.24	0.06
389	600500	中化国际	114,890	785,847.60	0.06
390	600521	华海药业	70,300	777,518.00	0.06
391	601880	大连港	419,860	776,741.00	0.06
392	600277	亿利洁能	137,000	775,420.00	0.06
393	600986	科达股份	184,320	772,300.80	0.06
394	600567	山鹰纸业	246,700	769,704.00	0.06
395	601000	唐山港	323,000	768,740.00	0.06
396	600099	林海股份	135,300	767,151.00	0.06
397	600894	广日股份	139,699	761,359.55	0.06
398	600827	百联股份	89,585	756,993.25	0.06
399	600079	人福医药	74,396	754,375.44	0.06
400	601168	西部矿业	128,769	749,435.58	0.06
401	600007	中国国贸	58,158	744,422.40	0.06
402	600056	中国医药	59,000	741,630.00	0.06
403	601128	常熟银行	120,700	741,098.00	0.06
404	600655	豫园股份	99,941	739,563.40	0.06
405	600468	百利电气	137,937	737,962.95	0.06
406	600338	西藏珠峰	37,900	736,397.00	0.06
407	600243	青海华鼎	190,000	735,300.00	0.05
408	600557	康缘药业	71,475	734,763.00	0.05
409	600889	南京化纤	159,500	733,700.00	0.05
410	600067	冠城大通	196,832	732,215.04	0.05
411	600761	安徽合力	83,499	730,616.25	0.05
412	601801	皖新传媒	109,100	728,788.00	0.05
413	600155	华创阳安	96,300	725,139.00	0.05
414	600200	江苏吴中	122,400	724,608.00	0.05
415	600475	华光股份	88,200	723,240.00	0.05

416	600331	宏达股份	356,427	719,982.54	0.05
417	603818	曲美家居	106,796	715,533.20	0.05
418	600777	新潮能源	373,599	713,574.09	0.05
419	603798	康普顿	69,400	701,634.00	0.05
420	600594	益佰制药	125,800	694,416.00	0.05
421	600266	北京城建	86,246	683,068.32	0.05
422	600239	云南城投	236,850	682,128.00	0.05
423	600551	时代出版	79,110	681,928.20	0.05
424	600293	三峡新材	171,800	671,738.00	0.05
425	600721	百花村	126,891	666,177.75	0.05
426	600051	宁波联合	122,292	659,153.88	0.05
427	601717	郑煤机	119,087	658,551.11	0.05
428	600526	菲达环保	148,200	655,044.00	0.05
429	600480	凌云股份	85,700	653,891.00	0.05
430	603188	亚邦股份	88,700	652,832.00	0.05
431	600378	天科股份	73,241	650,380.08	0.05
432	600717	天津港	91,561	647,336.27	0.05
433	600978	宜华生活	157,700	646,570.00	0.05
434	600657	信达地产	161,211	633,559.23	0.05
435	600037	歌华有线	73,537	631,682.83	0.05
436	601689	拓普集团	42,704	631,165.12	0.05
437	600291	西水股份	60,900	626,661.00	0.05
438	601375	中原证券	147,000	626,220.00	0.05
439	600435	北方导航	84,496	626,115.36	0.05
440	600584	长电科技	75,171	619,409.04	0.05
441	601608	中信重工	237,485	617,461.00	0.05
442	600881	亚泰集团	182,165	602,966.15	0.05
443	600758	红阳能源	183,300	595,725.00	0.04
444	600693	东百集团	110,997	582,734.25	0.04
445	600651	飞乐音响	179,000	578,170.00	0.04
446	600393	粤泰股份	270,300	573,036.00	0.04
447	600751	海航科技	199,375	540,306.25	0.04
448	600908	无锡银行	100,800	528,192.00	0.04
449	600123	兰花科创	78,085	509,114.20	0.04
450	600864	哈投股份	114,400	509,080.00	0.04
451	600306	商业城	78,900	501,804.00	0.04
452	601208	东材科技	134,570	497,909.00	0.04
453	601969	海南矿业	106,200	475,776.00	0.04
454	600223	鲁商置业	145,850	449,218.00	0.03
455	601515	东风股份	59,346	421,356.60	0.03
456	600261	阳光照明	117,524	400,756.84	0.03
457	600682	南京新百	44,700	392,466.00	0.03

458	600122	宏图高科	106,800	387,684.00	0.03
459	600284	浦东建设	76,483	379,355.68	0.03
460	600804	鹏博士	52,550	369,426.50	0.03
461	600685	中船防务	35,687	341,167.72	0.03
462	600525	长园集团	74,458	326,126.04	0.02
463	600975	新五丰	86,980	293,992.40	0.02
464	601003	柳钢股份	27,697	181,969.29	0.01
465	601066	中信建投	18,390	160,176.90	0.01
466	600901	江苏租赁	24,035	142,046.85	0.01
467	601828	美凯龙	12,805	141,367.20	0.01
468	601990	南京证券	10,030	87,261.00	0.01
469	603486	科沃斯	1,639	75,443.17	0.01
470	603712	七一二	3,923	69,868.63	0.01
471	603056	德邦股份	4,049	67,010.95	0.01
472	601330	绿色动力	4,874	60,681.30	0.00
473	600829	人民同泰	8,743	50,971.69	0.00
474	603650	彤程新材	2,376	47,116.08	0.00
475	600929	湖南盐业	5,596	46,055.08	0.00
476	603348	文灿股份	2,011	45,227.39	0.00
477	603897	长城科技	1,595	36,350.05	0.00
478	603596	伯特利	1,532	35,036.84	0.00
479	603301	振德医疗	1,066	33,845.50	0.00
480	603045	福达合金	891	25,571.70	0.00
481	603080	新疆火炬	1,187	24,737.08	0.00
482	603655	朗博科技	880	13,728.00	0.00
483	600267	海正药业	88	738.32	0.00
484	600138	中青旅	42	541.38	0.00
485	600162	香江控股	23	50.14	0.00

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600270	外运发展	67,800	1,423,122.00	0.11
2	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.00
3	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.00
4	603629	利通电子	1,051	40,684.21	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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

1	601288	农业银行	38,273,470.21	3.06
2	601857	中国石油	32,107,394.35	2.57
3	601988	中国银行	29,882,482.21	2.39
4	600036	招商银行	24,963,456.19	1.99
5	600519	贵州茅台	21,943,839.41	1.75
6	601318	中国平安	17,557,498.00	1.40
7	600028	中国石化	14,978,902.95	1.20
8	601328	交通银行	14,567,884.15	1.16
9	601628	中国人寿	13,288,365.68	1.06
10	601939	建设银行	11,286,012.82	0.90
11	601088	中国神华	9,531,377.00	0.76
12	600104	上汽集团	9,319,580.87	0.74
13	601166	兴业银行	8,904,525.80	0.71
14	600900	长江电力	8,647,499.18	0.69
15	600000	浦发银行	8,412,091.75	0.67
16	601668	中国建筑	6,538,823.55	0.52
17	600016	民生银行	6,029,394.00	0.48
18	601766	中国中车	6,017,448.08	0.48
19	601601	中国太保	5,820,936.40	0.47
20	601998	中信银行	5,660,885.22	0.45

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	16,716,760.21	1.34
2	601857	中国石油	14,707,903.00	1.18
3	601988	中国银行	12,905,363.00	1.03
4	600036	招商银行	11,069,523.97	0.88
5	600519	贵州茅台	9,408,135.01	0.75
6	601318	中国平安	8,082,327.29	0.65
7	600028	中国石化	7,110,847.65	0.57
8	601328	交通银行	6,273,700.00	0.50
9	601628	中国人寿	6,091,703.12	0.49
10	601939	建设银行	4,881,919.11	0.39
11	600104	上汽集团	4,140,926.73	0.33
12	601088	中国神华	4,045,578.85	0.32
13	600900	长江电力	3,923,637.53	0.31
14	601166	兴业银行	3,875,913.06	0.31
15	601225	陕西煤业	3,813,253.08	0.30
16	600000	浦发银行	3,686,788.37	0.29
17	601668	中国建筑	2,963,514.80	0.24

18	600673	东阳光科	2,863,145.20	0.23
19	601766	中国中车	2,794,428.03	0.22
20	600031	三一重工	2,737,155.12	0.22

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	719,587,134.93
卖出股票收入（成交）总额	334,573,434.69

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）	157,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	157,000.00	0.01

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	110049	海尔转债	1,570	157,000.00	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：本基金本报告期内未投资贵金属。

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

注：本基金本报告期末未有投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.1 本期国债期货投资评价

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形

本基金投资前十大证券中的中国人寿(601628.SH)于2018年7月30日发布公告，称收到《中国人民银行行政处罚决定书》(银反洗罚决字〔2018〕第5号)。中国人民银行认定，公司于2015年7月1日至2016年6月30日期间，未按照规定保存客户身份资料和交易记录以及未按照规定报送大额交易报告和可疑交易报告，依据《中华人民共和国反洗钱法》，公司被合计处以人民币70万元罚款。我司经过研究评估，认为此事件对中国人寿经营业绩未产生重大的实质影响，对其投资价值未产生实质影响。本基金持有该股经过合理的投资决策授权审批，符合指数基金投资管理规定。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	48,612.21
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	17,363.24
5	应收申购款	1,563,426.33
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,629,401.78

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	公司名称	流通受限部分的公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600270	外运发展	1,423,122.00	0.11	重大事项停牌
2	601860	紫金银行	50,145.80	0.00	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

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（%）
44,596	34,608.35	345,032,093.69	22.36	1,198,361,916.66	77.64

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	565,118.81	0.04

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 7 月 1 日）基金份额总额	9,097,758,651.47
本报告期期初基金份额总额	1,148,960,948.31
本报告期基金总申购份额	1,003,550,388.98
减：本报告期基金总赎回份额	609,117,326.94
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,543,394,010.35

注：表内“总申购份额”含转换入和红利再投份额；“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. 《汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 1 月 19 日正式生效，胡昕炜先生任该基金的基金经理。
2. 《汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 1 月 25 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。
3. 《汇添富熙和精选混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 2 月 11 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。
4. 《汇添富行业整合主题混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，赵鹏程先生任该基金的基金经理。
5. 《汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，陈健玮先生和劳杰男先生共同担任该基金的基金经理。
6. 《汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，陈加荣先生和胡娜女士共同担任该基金的基金经理。
7. 基金管理人于 2018 年 2 月 14 日公告，增聘胡娜女士为汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。
8. 基金管理人于 2018 年 3 月 2 日公告，劳杰男先生不再担任汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的基金经理，由李威先生单独管理该基金。
9. 基金管理人于 2018 年 3 月 2 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。
10. 《汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 3 月 8 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生共同担任该基金的基金经理。
11. 基金管理人于 2018 年 3 月 20 日公告，增聘赵鹏飞先生为汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生和胡娜女士共同管理该基金。
12. 《汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 3 月 23 日正式生效，吴振翔先生和许一尊先生共同担任该基金的基金经理。
13. 基金管理人于 2018 年 4 月 3 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富安鑫智选灵活配置混合型证

券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

14. 《汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 4 月 16 日正式生效，吴江宏先生和胡娜女士共同担任该基金的基金经理。

15. 《汇添富智能制造股票型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 4 月 23 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。

16. 《汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 4 月 26 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。

17. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，增聘徐寅喆女士为汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理，蒋文玲女士不再担任上述基金的基金经理。

18. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，增聘陶然先生为汇添富全额宝货币市场基金、汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，徐寅喆女士不再担任上述基金的基金经理。

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

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

21. 基金管理人于 2018 年 5 月 17 日公告，韩贤旺先生和欧阳沁春先生不再担任汇添富全球移动互联网灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，由杨璿先生单独管理该基金。

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

23. 基金管理人于 2018 年 5 月 29 日公告，聘任茹奕菡为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

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

25. 《汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同生效公告》于 2018 年 7 月 5 日正式生效，刘伟林先生任该基金的基金经理。

26. 基金管理人于 2018 年 7 月 7 日公告, 增聘曾刚先生和郑慧莲女士为汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 李怀定先生不再担任该基金的基金经理。
27. 基金管理人于 2018 年 7 月 7 日公告, 增聘胡娜女士为汇添富纯债债券型证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 与陆文磊先生、李怀定先生共同管理该基金。
28. 基金管理人于 2018 年 7 月 7 日公告, 增聘何旻先生、杨璿先生和刘江先生为汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 与刘伟林先生共同管理该基金。
29. 基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告, 李怀定先生不再担任汇添富纯债债券型证券投资基金 (LOF)、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的基金经理, 由陆文磊先生和胡娜女士管理该基金。
30. 基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告, 李怀定先生不再担任汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理, 由陆文磊先生单独管理上述基金。
31. 基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告, 李怀定先生不再担任汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理, 由陆文磊先生、郑慧莲女士和胡娜女士管理该基金。
32. 基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告, 李怀定先生不再担任汇添富睿丰混合型证券投资基金的基金经理, 增聘蒋文玲女士为该基金的基金经理, 与赵鹏飞先生共同管理该基金。
33. 基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告, 李怀定先生不再担任汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理, 由曾刚先生单独管理上述基金。
34. 基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告, 增聘蒋文玲女士为汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 李怀定先生不再担任该基金的基金经理。
35. 基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告, 李怀定先生不再担任汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金的基金经理, 由何旻先生单独管理该基金。
36. 基金管理人于 2018 年 8 月 8 日公告, 增聘温开强先生为汇添富理财 30 天债券型证券投资基金的基金经理, 与徐寅喆女士共同管理该基金。
37. 《汇添富创新医药主题混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 8 月 8 日正式生效, 刘江先生和郑磊先生共同担任该基金的基金经理。
38. 基金管理人于 2018 年 8 月 23 日公告, 增聘徐光先生为汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理, 与陆文磊先生共同管理上述基金。

39. 《汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 9 月 21 日正式生效，陈健玮先生任该基金的基金经理。
40. 《汇添富全球消费行业混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 9 月 21 日正式生效，胡昕炜先生和郑慧莲女士共同担任该基金的基金经理。
41. 基金管理人于 2018 年 9 月 29 日公告，增聘吴江宏先生为汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生、郑慧莲女士共同管理上述基金。
42. 基金管理人于 2018 年 9 月 29 日公告，增聘徐光先生为汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理上述基金。
43. 《中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 10 月 23 日正式生效，过蓓蓓女士任该基金的基金经理。
44. 基金管理人于 2018 年 11 月 17 日公告，陈加荣先生不再担任汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，由吴江宏先生和郑慧莲女士管理上述基金。
45. 基金管理人于 2018 年 11 月 17 日公告，陈加荣先生不再担任汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金的基金经理，由徐光先生单独管理上述基金。
46. 基金管理人于 2018 年 11 月 17 日公告，陈加荣先生不再担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，由赵鹏飞先生和胡娜女士管理该基金。
47. 《汇添富经典成长定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 12 月 5 日正式生效，雷鸣先生任该基金的基金经理。
48. 《汇添富短债债券型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 12 月 13 日正式生效，蒋文玲女士任该基金的基金经理。
49. 《汇添富消费升级混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 12 月 21 日正式生效，胡昕炜先生和郑慧莲女士共同担任该基金的基金经理。
50. 《汇添富丰润中短债债券型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 12 月 24 日正式生效，徐光先生和蒋文玲女士共同担任该基金的基金经理。
51. 基金管理人于 2018 年 12 月 26 日公告，增聘茹奕菡女士为汇添富安心中国债券型证券投资基金的基金经理，与何旻先生共同管理该基金。

52. 《汇添富养老目标日期 2030 三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同生效公告》于 2018 年 12 月 27 日正式生效，蔡健林先生任该基金的基金经理。

53. 基金管理人于 2018 年 12 月 29 日公告，倪健先生不再担任汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金的基金经理，增聘杨威风先生为该基金的基金经理，与余中强先生共同管理该基金。

54. 基金管理人于 2018 年 12 月 29 日公告，增聘杨威风先生为汇添富香港优势精选混合型证券投资基金的基金经理，倪健先生不再担任该基金的基金经理。

55. 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（2009 年 7 月 1 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捌万元整。

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	
东方证券	2	764,769,921.38	72.69%	712,225.29	72.69%	—
东吴证券	1	218,936,206.69	20.81%	203,896.45	20.81%	—
中信建投	1	68,320,950.44	6.49%	63,628.05	6.49%	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—

广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证 券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

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
东方证券	1,496,583.80	100.00%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

江海证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。
- (8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内退租 3 家证券公司的 3 个交易单元:东兴证券(上交所单元)、中投证券(上交所单元)、中信证券(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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2017 年资产净值的公告	公司网站	2018-01-02
2	关于汇添富上证综合指数证券投资基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-01-10
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加农业银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-01-12
4	汇添富上证综合指数证券投资基金收益分配公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-01-16
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗	中证报, 证券时报, 上证	2018-01-19

	下部分基金增加南洋商业银行为代销机构的公告	报, 公司网站	
6	汇添富基金管理有限公司旗下公募基金 2017 年第 4 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-01-22
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加东亚银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-01-30
8	汇添富上证综合指数证券投资基金更新招募说明书(2018 年第 1 号)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-02-13
9	关于汇添富基金管理股份有限公司旗下 93 只基金修订基金合同的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 公司网站, 深交所	2018-03-24
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下 93 只基金 2017 年年度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-03-28
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加东亚银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-03-30
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-03-30
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加工商银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-03-30
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加途牛金服为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-03-31
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加电盈基金为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-04-09
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加南洋商业银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-04-19
17	汇添富基金旗下 99 只基金 2018 年第 1 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-04-21
18	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加凯石财富开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-04-23
19	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加东亚银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-06-29
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2018 半年资产净值的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-06-30

21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加钜派钰茂为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-07-11
22	汇添富基金管理股份有限公司旗下 108 只基金 2018 年 2 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-07-18
23	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加朝阳永续为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-07-19
24	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加嘉实财富为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-07-26
25	汇添富上证综合指数证券投资基金更新招募说明书及摘要(2018 年第 2 号)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-08-14
26	汇添富基金管理股份有限公司旗下 108 只基金 2018 年半年度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-08-25
27	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加挖财基金为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-09-21
28	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-10-09
29	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在肯特瑞最低申购金额、最低赎回份额和最低账户持有份额的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-10-20
30	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在肯特瑞最低定期定额投资金额的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-10-23
31	汇添富基金旗下 111 只基金 2018 年第 3 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-10-26
32	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-11-10
33	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加有鱼基金为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-11-20
34	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加阳光人寿为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-12-06
35	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加浦发银行开展的费率	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-12-11

	优惠活动的公告		
36	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加百度百盈为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-12-12

§ 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上证综合指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富上证综合指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富上证综合指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 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

2019 年 03 月 26 日