基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2015年8月29日

汇添富恒生指数分级证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015年6月30日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月27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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富恒生指数分级 (QDII)		
场内简称	添富恒生		
基金主代码	164705		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年3月6日		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	6,095,023,361.23份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2014-04-11		
下属分级基金的基金简称:	添富恒生	恒生A	恒生B
下属分级基金的交易代码:	164705	150169	150170
报告期末下属分级基金的份额总额	684,966,667.23份	2,705,028,347.00份	2,705,028,347.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,具有与标的指数及标的指数所表征的股票市场相似的风险收益特征。在股票基金中属于中等风险、中等收益的产品。本基金为境外证券投资的基金,主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。此外,从投资者具体持有的基金份额来看,在分级运作期内,由于基金收益分配的安排,稳健收益类的恒生A份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额;积极收益类的恒生B份额则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	林蕊
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	tgxxpl@abc.china.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-68121816

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.
	中文	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		香港九龙深旺道一号,汇丰中心一座六楼

2.5 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半年度报告备置地点	上海市富城路99号震旦国际大楼21楼汇添富基金管理股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	-37,842,941.75
本期利润	-287,058,259.89
加权平均基金份额本期利润	-0.1000
本期基金份额净值增长率	2.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0654
期末基金资产净值	6,511,787,607.44
期末基金份额净值	1.068

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

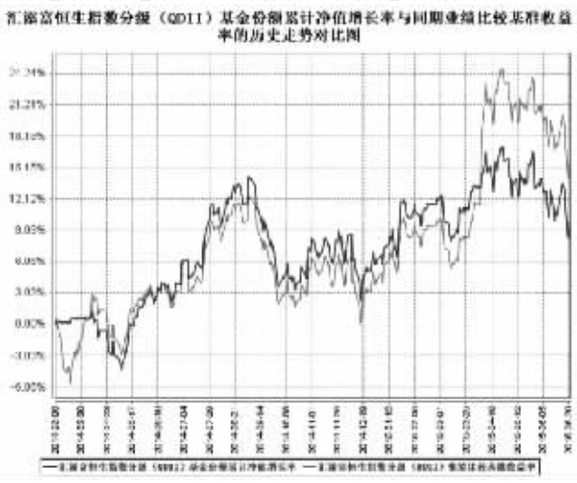
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.35%	1.14%	-4.14%	1.12%	0.79%	0.02%
过去三个月	-3.17%	1.05%	4.73%	1.22%	-7.90%	-0.17%
过去六个月	2.98%	0.91%	10.62%	0.99%	-7.64%	-0.08%
过去一年	5.26%	0.87%	11.87%	0.92%	-6.61%	-0.05%
自基金合同生效日起至今	9.36%	0.81%	15.39%	0.89%	-6.03%	-0.08%

注:本基金的(基金合同)生效日为2014年3月6日,至本报告期末未满三年。

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



注:本基金的(基金合同)生效日为2014年3月6日,本基金建仓期为本(基金合同)生效之日(2014年3月6日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。截至本报告期末,基金成立未满三年。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立,经中国证监会证监基金字[2005]5号文批准,于2005年2月3日正式成立,注册资本金为1亿元人民币。截止到2015年6月30日,公司管理证券投资基金规模约2,198.54亿元,有效客户数约600万户,资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理53只开放式证券投资基金,形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征,较为完善、有效的产品线,包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富价值精选混合型证券投资基金、汇添富均衡增长股票型证券投资基金、汇添富成长焦点股票型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添富香港优势股票型证券投资基金、汇添富医药保健股票型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)、深证300交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财30天债券型证券投资基金、汇添富理财60天债券型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、汇添富理财7天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金、汇添富消费行业股票型证券投资基金、汇添富理财7天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽30股票型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富互利分级债券型证券投资基金、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富添富通货币市场基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富成长多因子量化策略股票基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务混合型证券投资基金。

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		
赖中立	汇添富上证综合指数基金的基金经理助理,汇添富黄金及贵金属基金(LOF)的基金经理,汇添富恒生指数分级(QDII)基金,汇添富深证300ETF基金,汇添富深证300ETF联接基金,汇添富香港优势精选股票基金的基金经理。	2014年3月6日	-	8年	国籍:中国,学历:北京大学中国经济研究中心金融学硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属基金(LOF)的基金经理。2014年3月6日至今任汇添富恒生指数分级(QDII)基金的基金经理。2015年1月6日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金的基金经理。2015年5月26日至今任汇添富香港优势精选股票基金的基金经理。

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合、交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资品种,并贯穿立了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程化化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为1次,是由于投资流动性的需求导致。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15年一季度,香港股票市场震荡蓄势,相比于热火朝天的A股行情,恒生指数涨幅不大。三月底四月初,香港市场政策暖风频吹:证监会放开公募基金投资港股限制,保监会放宽险资投资香港创业板的限制。在诸多因素刺激之下,恒生指数在短短两周内引发了爆炸式的上涨行情,恒生指数做多热情浓厚。进入二季度,香港股票市场振幅较大,但相比于近期非理性下跌的A股行情,恒生指数相对较为稳定。然而6月份以来,政改投票失利,A股市场大跌,希腊债务违约甚至退欧以及美国加息预期的不稳定因素纷至沓来,在重重利空的打击下,香港市场从前期盘整的平台一路下行,投资者观望情绪浓厚。

报告期内,本基金按照基金合同,按照完全复制法进行恒生指数成份股指数化投资,严控基金跟踪误差,以期为投资者带来与恒生指数一致的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,基金净值上涨2.98%,业绩比较基准上涨10.62%,超额收益为-7.64%。

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15年下半年,港股市场的投资看目前正处于下跌行情中的恐慌阶段。而在以机构主导的香港市场,当市场出现非理性行为时,市场恢复的速度是较快的。我们认为,若市场继续非理性下行,则股票市场的价值发现作用将很快得以凸显,香港市场价格低廉的优质股票将非常具有吸引力。

从估值角度来看,恒生指数在2011年、2012年和2013年三轮历史底部的估值均值为8.5倍,当前恒生指数动态市盈率为10.16倍,即便进行最为悲观的考虑,当前位置继续下行的空间也仅为10-20%。在这个估值区间进行分批配置将是比较稳健的投资策略。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范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规定,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、产品创新部、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会,负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金(基金合同)约定:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%,若(基金合同)生效不满3个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司 2015年 1月1日至 2015年 6 月30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:汇添富恒生指数分级证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	3,716,426,000.16	18,186,270.67
结算备付金	146,076,320.12	-
存出保证金	259,503,949.65	-
交易性金融资产	2,768,009,439.05	157,841,898.87
其中:股票投资	2,768,009,439.05	157,841,898.87
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	114,276,599.30	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	711,240.99	1,676.86
应收股利	32,879,754.03	-
应收申购款	442,817.51	145,963.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,038,326,120.81	176,175,809.41
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	114,276,599.30	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	347,46	-
应付赎回款	391,740,826.71	2,464,735.28
应付管理人报酬	13,602,562.16	167,802.92
应付托管费	2,833,867.14	34,958.92
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,760,790.75	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,323,519.85	320,253.87
负债合计	526,538,513.37	2,987,750.99
所有者权益:		
实收基金	6,091,110,044.00	163,086,548.73
未分配利润	420,677,563.44	10,101,509.69
所有者权益合计	6,511,787,607.44	173,188,058.42
负债和所有者权益总计	7,038,326,120.81	176,175,809.41

注:①报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.068元,基金份额总额6,095,023,361.23份,其中下属添富恒生份额净值1.068元,份额总额684,966,667.23份;下属恒生A份额净值1.027元,份额总额2,705,028,347份;下属恒生B份额净值1.109元,份额总额2,705,028,347份。

②本基金合同于2014年3月6日生效。

6.2 利润表

会计主体:汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日
一、收入	-254,650,423.95	15,867,851.30
1.利息收入	5,642,287.44	2,515,497.36
其中:存款利息收入	5,642,287.44	2,515,497.36
债券利息收入	-	-
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)	9,551,283.62	3,666,787.84
其中:股票投资收益	33,465,131.75	-440,001.35
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-66,677,446.85	-
股利收益	42,763,598.72	4,106,789.19
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-249,215,318.14	1,741,137.73
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-23,074,213.91	6,501,570.78
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,445,537.04	1,442,857.59
减:二、费用	32,407,835.94	4,520,385.79
1.管理人报酬	18,410,912.37	2,098,893.85
2.托管费	3,835,606.78	437,269.53
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	9,150,191.04	1,775,548.80
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	1,011,125.75	208,673.61
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-287,058,259.89	11,347,465.51

注:后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期:2015年1月1日 至 2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	163,086,548.73	10,101,509.69	173,188,058.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-287,058,259.89	-287,058,259.89
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)	5,928,023,495.27	697,634,313.64	6,625,657,808.91
其中:1.基金申购款	69,312,002,155.27	887,244,296.20	70,199,246,451.47
2.基金赎回款	-63,383,978,660.00	-189,609,982.56	-63,573,588,642.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	6,091,110,044.00	420,677,563.44	6,511,787,607.44

项目	上年度可比期间 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	11,347,465.51	11,347,465.51
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)	125,171,847.20	-6,504,505.81	118,667,341.39
其中:1.基金申购款	1,272,926,851.64	16,674.93	1,272,943,526.57
2.基金赎回款	-1,147,755,004.44	-6,521,180.74	-1,154,276,185.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	125,171,847.20	4,842,959.70	130,014,806.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

张晖 陈灿辉 韩从慧

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富恒生指数分级证券投资基金(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[2013]1247号文《关于核准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人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2014年3月6日正式生效,首次设立募集规模为1,270,631,138.98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为汇添富基金管理股份有限公司,本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司,境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司(The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.)。

本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标,基金还可投资于债券、基金(包括股票基金、债券基金、交易所交易基金等)、金融衍生工具(包括远期合约、互换、期货、期权、权证等)、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的80%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。本基金的业绩比较基准为:人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在其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制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至6月30日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,自2015年4月3日起,本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。除以上会计估计的变更,本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

①以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税;

②基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂免征营业税和企业所得税;

③基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	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
文汇新民联合报业集团	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
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
汇添富资本管理有限公司	基金管理人施加重大影响的联营企业
香港上海汇丰银行有限公司(汇丰银行)	基金境外托管人

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东方证券股份有限公司	1,760,792,477.71	46.69%	-	-

6.4.7.1.2 债券交易

注:本基金本报告期未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

注:本基金本报告期未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.7.1.4 基金交易

注:本基金本报告期未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.7.1.5 权证交易

注:本基金本报告期未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.7.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	1,760,790.75	100.00%	1,760,790.75	100.00%

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,410,912.37	2,098,893.85
其中:支付销售机构的客户维护费	329,191.02	708,486.28

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.20%÷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款指令,基金托管人复核后于次月前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、公休假等,支付日期顺延。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,835,606.78	437,269.53

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.7.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本报告期内及上年度可比区间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.7.3.2 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:报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.7.4 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	3,531,993,988.44	5,642,287.44	9,541,197.52	486,295.60
汇丰银行	184,432,011.72	-	190,390.75	-

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国农业银行和境外资产托管人汇丰银行保管,按适用利率计息。

6.4.7.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.8 利润分配情况

6.4.8.1 利润分配情况——非货币市场基金

注:本基金在本期内未进行利润分配。

6.4.9 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本期末未持有暂时停牌股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,768,009,439.05	39.33
	其中:普通股	2,768,009,439.05	39.33
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	114,276,599.30	1.62
	其中:远期	-	-
	期货	114,276,599.30	1.62
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,862,502,320.28	54.88
8	其他各项资产	293,537,762.18	4.17
9	合计	7,038,326,120.81	100