

汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 25 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 7 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 14 |
| 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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 16 |
| 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..... | 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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计） | 18 |
| 6.1 资产负债表..... | 18 |
| 6.2 利润表..... | 19 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 20 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 21 |
| §7 投资组合报告..... | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 41 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 41 |
| 7.3 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..... | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 43 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 45 |
| 7.6 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..... | 45 |
| 7.7 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..... | 45 |
| 7.8 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..... | 45 |
| 7.9 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..... | 45 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 45 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 45 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 45 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 47 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 47 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 47 |
| 8.3 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的情况..... | 47 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 48 |
| §10 重大事件揭示..... | 49 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 49 |
| 10.2 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..... | 49 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 50 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 50 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 50 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 51 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 51 |
| 10.8 其他重大事件..... | 53 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 55 |
| 11.1 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..... | 55 |

| | |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 56 |
| §12 备查文件目录..... | 57 |
| 12.1 备查文件目录..... | 57 |
| 12.2 存放地点..... | 57 |
| 12.3 查阅方式..... | 57 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 汇添富沪港深新价值股票 |
| 基金主代码 | 001685 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 7 月 27 日 |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 340,539,689.91 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金精选相对低估的优质企业进行中长期投资，采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中，在资产配置中，在综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素的基础上，结合全球宏观经济形势，研判国内外经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，对投资组合中股票、债券、货币市场工具盒法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种进行战略配置和动态调整，以规避或分散市场风险；在股票投资中，采取“自下而上”的策略，优选价值相对低估的优质公司股票构建投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得长期持续稳健的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合指数收益率×20% |
| 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预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 |

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李鹏 | 田青 |
| | 联系电话 | 021-28932888 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | service@99fund.com | tianqingl.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-9918 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-28932998 | 010-66275853 |
| 注册地址 | | 上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室 | 北京市西城区金融大街25号 |
| 办公地址 | | 上海市富城路99号震旦国际大楼19-22层 | 北京市西城区闹市口大街一号院一号楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100033 |
| 法定代表人 | | 李文 | 田国立 |

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19-22层 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 |
|--------|---------------|-----------------------|
| 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19-22层 |

§ 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(2018年1月1日 - 2018年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 45,652,751.03 |
| 本期利润 | -47,110,803.83 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0809 |
| 本期加权平均净值利润率 | -6.29% |
| 本期基金份额净值增长率 | -4.79% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 85,554,220.38 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2512 |
| 期末基金资产净值 | 426,093,910.29 |
| 期末基金份额净值 | 1.251 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2018年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 25.10% |

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。

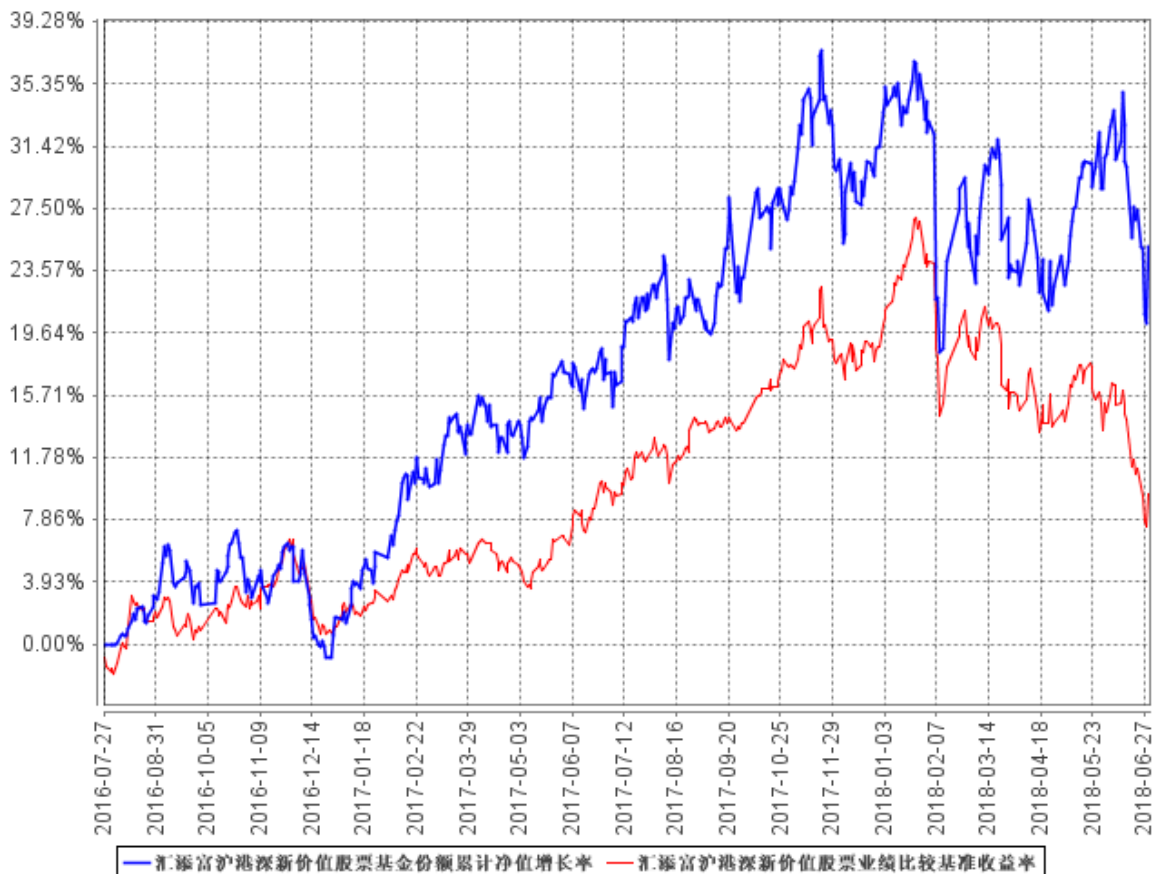
3.2 基金净值表现

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 | -4.28% | 1.76% | -4.95% | 0.97% | 0.67% | 0.79% |
| 过去三个月 | 1.21% | 1.42% | -5.58% | 0.86% | 6.79% | 0.56% |
| 过去六个月 | -4.79% | 1.47% | -7.83% | 0.89% | 3.04% | 0.58% |
| 过去一年 | 6.92% | 1.31% | -0.40% | 0.73% | 7.32% | 0.58% |
| 自基金合同生效日起至 今 | 25.10% | 1.08% | 9.47% | 0.63% | 15.63% | 0.45% |

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

汇添富沪港深新价值股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016年7月27日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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 132,724,224 元人民币。截止到 2018 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 4213.15 亿元，有效客户数约 1988 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 110 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、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长混合型证券投资基金、汇添富成长焦点混合型证券投资基金、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、汇添富价值精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富民营活力混合型证券投资基金、汇添富香港优势混合型证券投资基金、汇添富医疗保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、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 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、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、汇添富优选回报混合型证券投资基金、汇添富消费行业混合型证券投资基金、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 混合型证券投资基金、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、汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）、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、汇添富外延增长主题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、汇添富国企创新增长股票型证券投资基金、汇添富民营新动力股票型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富新兴消费股票型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金、汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富盈安保本混合型证券投资基金、汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金、汇添富盈稳保本混合型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫保本混合型证券投资基金、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金、汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）、汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金、汇添富鑫利债券型证券投资基金、汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、汇添富中国高端制造股票型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富精选美元债债券型证券投资基金、汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金、汇添富添福吉祥混合型证券投资基金、汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金、汇添富盈润混合型证券投资基金、汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富民丰回报混合型证券投资基金、汇添富睿丰混合型证券投资基金、汇添富弘安混合型证券投资基金、汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金、汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）、上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金、汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金、汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金、汇添富行业整合主题混合型证券投资基金、汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金、汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富智能制造股票型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发

起式证券投资基金、汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富文体娱乐主题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 | | |
| 顾耀强 | 汇添富策略回报混合基金、汇添富逆向投资混合基金、汇添富沪港深新价值股票基金、汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理。 | 2016年7月27日 | - | 14年 | 国籍：中国。学历：清华大学管理学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任高级行业分析师、基金经理助理，2009年12月22日至今任汇添富策略回报混合基金的基金经理，2012年3月9日至今任汇添富逆向投资混合基金的基金经理，2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合基金的基金经理，2016年7月27日至今任汇添富沪港深新价值股票基金的基金经理，2017年3月15日至今任汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理。 |
| 赵鹏程 | 汇添富沪港深新价值股票基金、添富行业整合混合基金的基金经理。 | 2016年7月27日 | - | 7年 | 国籍：中国，学历：浙江大学高分子化学与物理硕士。曾任天相投资股份有限公司研究员、信诚基金管理有限公司研究员。2011年8月加入汇添富基金管理有限公司任高级行业分析师。2016年7月27日至今任汇添富沪港深新价值股票基金的基金经理。 |

| | | | | | |
|-----|---|----------------|---|------|--|
| | | | | | 理，2018 年 2 月 13 日至今任添富行业整合混合基金的基金经理。 |
| 余中强 | 汇添富沪港深新价值股票基金、汇添富均衡增长混合基金、添富港股通专注成长基金的基金经理。 | 2016 年 8 月 1 日 | - | 11 年 | 国籍：中国。学历：香港城市大学博士，清华大学 MBA 学位。从业经历：曾任香港邦盟汇骏基金管理有限公司研究主任、香港朗宁投资有限公司投资经理、东兴证券股份有限公司投资经理、齐鲁证券有限公司北京证券资产管理分公司执行总经理、华商盛世成长股票型基金基金经理助理、华商产业升级混合型基金经理。2016 年 1 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2016 年 8 月 1 日至今任汇添富沪港深新价值股票基金的基金经理，2016 年 8 月 24 日至今任汇添富均衡增长混合基金的基金经理，2017 年 11 月 10 日至今任添富港股通专注成长基金的基金经理。 |

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，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、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，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，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 4 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

2018 年上半年，在美国经济的持续向好，以及由此导致的美联储加快加息和缩表节奏的背景下，美元震荡走强，美国资本市场受益于资金从新兴市场撤出，以及权重公司业绩持续超预期，而呈现出一枝独秀的表现。其他大部分权益市场表现一般，在二季度中后期，更是受到强势美元的冲击，风险偏好加速回落，股指表现承压。总体而言，港股市场中，科技类和消费类的绩优公司的相对表现仍较为亮眼。

18 年年初，在金融股强力表现的带领下，市场整体的正收益明显。核心点还是因为港股市场优质标的低估值的吸引力。但是，从 2 月开始，由于美国经济复苏进一步加快，在就业、通胀数据超预期的背景下，市场预期美联储将加快加息、缩表的力度，导致了美股市场的剧烈调整，进

而拖累了港股市场。二季度开始，港股的表现进一步疲弱，权重股对于年初涨幅的回吐明显，导致市场整体下行。在中国去杠杆、国际贸易摩擦加剧、人民币贬值、美联储加速加息、缩表等一系列因素的影响下，港股市场遭遇了持续的资金流出，前期涨幅较大的权重股成为重灾区。本基金在上半年进一步加大了持股集中度，将持仓重心放在弱经济周期、景气度持续上行的行业，从中挑选并重仓优秀标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.251 元；本报告期基金份额净值增长率为-4.79%，业绩比较基准收益率为-7.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预判 2018 年下半年全球经济仍将保持稳步复苏的节奏。美联储的加速缩表，在刺激美元强势的同时，也将进一步吸引全球资金从新兴市场往成熟市场再配置。如果大宗商品的价格进一步上涨，则全球的通胀压力将进一步显现，这会导致主要国家跟随美国的步伐，加速货币政策回归常态化。因此，从全球范围来看，受益于利率上行的板块大概率将在下半年迎来不错的投资机会。

中国经济的稳步增长，将进一步有利于在港上市中资企业的盈利持续增长，这也将有助于恒生国企指数在未来的表现。同时，港交所对于创新企业上市的政策支持，以及更多优秀的科创企业选择香港上市，从长远的角度，将进一步有利于整体市场的长期发展。在未来一阶段，我们仍将仓位更多的集中在行业景气度上行、发展战略清晰、估值合理、增速稳定的标的上。同时，在全球通胀持续上行的过程中，我们将继续加大受益利率上行优秀标的的配置比重。

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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进

行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

4.7 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：基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位收益分配金额后不能低于面值。

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

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 37,717,373.24 | 125,157,599.57 |
| 结算备付金 | | 6,385,920.23 | 29,903,221.86 |
| 存出保证金 | | 30,599.19 | 3,623,689.82 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 380,317,890.32 | 747,536,395.28 |
| 其中：股票投资 | | 380,317,890.32 | 747,536,395.28 |
| 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 2,118,226.12 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 9,453.20 | 39,801.20 |
| 应收股利 | | 1,802,265.17 | - |
| 应收申购款 | | 547,356.24 | 10,843,828.39 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 428,929,083.71 | 917,104,536.12 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2018 年 6 月 30 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 715,041.61 | 49,097,218.37 |
| 应付赎回款 | | 626,565.43 | 3,931,232.12 |
| 应付管理人报酬 | | 577,390.13 | 1,065,073.73 |
| 应付托管费 | | 96,231.69 | 177,512.29 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 525,998.65 | 457,372.28 |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 293,945.91 | 373,615.97 |
| 负债合计 | | 2,835,173.42 | 55,102,024.76 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 340,539,689.91 | 655,987,716.67 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 85,554,220.38 | 206,014,794.69 |
| 所有者权益合计 | | 426,093,910.29 | 862,002,511.36 |
| 负债和所有者权益总计 | | 428,929,083.71 | 917,104,536.12 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.251 元，基金份额总额 340,539,689.91 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | -36,567,758.69 | 233,763,429.02 |
| 1.利息收入 | | 481,001.01 | 1,469,817.88 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 481,001.01 | 1,208,698.04 |
| 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 | | - | 261,119.84 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 54,292,281.32 | 92,158,776.59 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 48,321,133.31 | 80,872,451.02 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.1 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 5,971,148.01 | 11,286,325.57 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -92,763,554.86 | 138,341,964.55 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 1,422,513.84 | 1,792,870.00 |
| 减：二、费用 | | 10,543,045.14 | 24,909,176.47 |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 5,597,338.32 | 11,657,885.94 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 932,889.69 | 1,942,980.97 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 3,814,740.64 | 11,121,421.01 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 198,076.49 | 186,888.55 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -47,110,803.83 | 208,854,252.55 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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） | 655,987,716.67 | 206,014,794.69 | 862,002,511.36 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -47,110,803.83 | -47,110,803.83 |
| 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） | -315,448,026.76 | -73,349,770.48 | -388,797,797.24 |
| 其中：1.基金申购款 | 264,076,938.50 | 87,637,674.49 | 351,714,612.99 |
| 2.基金赎回款 | -579,524,965.26 | -160,987,444.97 | -740,512,410.23 |
| 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） | 340,539,689.91 | 85,554,220.38 | 426,093,910.29 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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) | 1,613,296,308.34 | 27,747,706.99 | 1,641,044,015.33 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 208,854,252.55 | 208,854,252.55 |
| 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) | -566,921,448.99 | -59,157,067.69 | -626,078,516.68 |
| 其中：1.基金申购款 | 453,204,938.94 | 58,182,893.93 | 511,387,832.87 |
| 2.基金赎回款 | -1,020,126,387.93 | -117,339,961.62 | -1,137,466,349.55 |
| 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) | 1,046,374,859.35 | 177,444,891.85 | 1,223,819,751.20 |

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 李骁 雷青松
 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

汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金（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[2016]148号文《关于准予汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金变更注册的批复》的核准，由基金管理人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2016年7月27日正式生效，首次设立募集规模为408,053,169.08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及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法发行上市的股票（包含中小板、

创业板、其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、股票期权、债券、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票资产不低于基金资产的 80% (其中投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%); 基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%; 每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的保证金以后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率 \times 60%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算) \times 20%+中债综合指数收益率 \times 20%。

6.4.2 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。

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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年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、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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、国家税务总局财税字[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。

6.4.6.2 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，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]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再

缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。

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

6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外

相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 37,717,373.24 |
| 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 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 37,717,373.24 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 | | |
|-------------------|------------------------|----------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 353,642,414.87 | 380,317,890.32 | 26,675,475.45 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 353,642,414.87 | 380,317,890.32 | 26,675,475.45 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 8,606.89 |
| 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 | 779.19 |
| 应收债券利息 | - |
| 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 | 32.63 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 34.49 |
| 合计 | 9,453.20 |

注：“其他”为应收港股风控金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 525,998.65 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 525,998.65 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2018 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 549.22 |
| 应付信息披露费 | 248,765.71 |
| 应付审计费 | 44,630.98 |
| 合计 | 293,945.91 |

6.4.7.9 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 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 655,987,716.67 | 655,987,716.67 |
| 本期申购 | 264,076,938.50 | 264,076,938.50 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -579,524,965.26 | -579,524,965.26 |
| - 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 | 340,539,689.91 | 340,539,689.91 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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 | 129,201,278.75 | 76,813,515.94 | 206,014,794.69 |
| 本期利润 | 45,652,751.03 | -92,763,554.86 | -47,110,803.83 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -74,443,558.63 | 1,093,788.15 | -73,349,770.48 |
| 其中：基金申购款 | 55,628,558.34 | 32,009,116.15 | 87,637,674.49 |
| 基金赎回款 | -130,072,116.97 | -30,915,328.00 | -160,987,444.97 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 100,410,471.15 | -14,856,250.77 | 85,554,220.38 |

6.4.7.11 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 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
| | |

| | |
|-----------|------------|
| 活期存款利息收入 | 378,368.54 |
| 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 | 83,868.54 |
| 其他 | 18,763.93 |
| 合计 | 481,001.01 |

注：其中“其他”为直销申购款利息收入与港股风控金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,087,135,238.01 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,038,814,104.70 |
| 买卖股票差价收入 | 48,321,133.31 |

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 5,971,148.01 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 5,971,148.01 |

6.4.7.17 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6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -92,763,554.86 |
| ——股票投资 | -92,763,554.86 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——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 | -92,763,554.86 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,422,513.84 |
| 合计 | 1,422,513.84 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 3,814,740.64 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 3,814,740.64 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|------|----------------------------|
| 审计费用 | 44,630.98 |

| | |
|---------|------------|
| 信息披露费 | 148,765.71 |
| 账户维护费 | - |
| 银行间划款费用 | 4,279.80 |
| 其他费用 | 400.00 |
| 合计 | 198,076.49 |

注：其中“其他费用”为开户费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 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、基金注册登记机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（“建设银行”） | 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 |

注：以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 | 1,325,940,250.66 | 71.61% | 5,231,520,669.66 | 100.00% |

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|------------|----------------------------|--------------------|---------------------------------|------------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的比例 |
| 东方证券股份有限公司 | - | - | 1,975,000,000.00 | 100.00% |

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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 | 1,284,444.32 | 74.44% | 212,994.75 | 40.49% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 | 5,231,517.30 | 100.00% | 2,911,758.54 | 100.00% |

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月 30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,597,338.32 | 11,657,885.94 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 666,314.99 | 543,414.74 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。

若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 932,889.69 | 1,942,980.97 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在

月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 37,717,373.24 | 378,368.54 | 163,707,668.78 | 892,103.79 |

6.4.10.6 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参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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。

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，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。

6.4.13.3.1 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。

本基金所持全部证券均在证券交易所上市；因此，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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产及部分应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2018年6月30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 | 37,717,373.24 | - | - | - | - | - | 37,717,373.24 |
| 结算备付金 | 6,385,920.23 | - | - | - | - | - | 6,385,920.23 |
| 存出保证金 | 30,599.19 | - | - | - | - | - | 30,599.19 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 380,317,890.32 | 380,317,890.32 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 2,118,252.42 | 2,118,252.42 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 9,453.20 | 9,453.20 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 1,802,265.17 | 1,802,265.17 |
| 应收申购款 | 306,738.76 | - | - | - | - | 240,617.48 | 547,356.24 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | -26.30 | -26.30 |
| 资产总计 | 44,440,631.42 | - | - | - | - | 384,488,452.29 | 428,929,083.71 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 715,067.91 | 715,067.91 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 626,565.43 | 626,565.43 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 577,390.13 | 577,390.13 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 96,231.69 | 96,231.69 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 525,998.65 | 525,998.65 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 293,919.61 | 293,919.61 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 2,835,173.42 | 2,835,173.42 |
| 利率敏感度缺口 | 44,440,631.42 | - | - | - | - | 381,653,278.87 | 426,093,910.29 |
| 上年度末 2017年12月31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 125,157,599.57 | - | - | - | - | - | 125,157,599.57 |
| 结算备付金 | 29,903,221.86 | - | - | - | - | - | 29,903,221.86 |
| 存出保证金 | 3,623,689.82 | - | - | - | - | - | 3,623,689.82 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 747,536,395.28 | 747,536,395.28 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 39,801.20 | 39,801.20 |
| 应收申购款 | 10,179,127.12 | - | - | - | - | 664,701.27 | 10,843,828.39 |
| 资产总计 | 168,863,638.37 | - | - | - | - | 748,240,897.75 | 917,104,536.12 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 49,097,218.37 | 49,097,218.37 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 3,931,232.12 | 3,931,232.12 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,065,073.73 | 1,065,073.73 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 177,512.29 | 177,512.29 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 457,372.28 | 457,372.28 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 373,615.97 | 373,615.97 |

| | | | | | | |
|---------|----------------|---|---|---|-----------------|----------------|
| 负债总计 | - | - | - | - | 55,102,024.76 | 55,102,024.76 |
| 利率敏感度缺口 | 168,863,638.37 | - | - | - | -693,138,872.99 | 862,002,511.36 |

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末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。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | | | |
|---------------|------------------|----------------|---------------|----------------|
| | 2018 年 6 月 30 日 | | | |
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 380,317,890.32 | - | 380,317,890.32 |
| 应收股利 | - | 1,166,570.77 | - | 1,166,570.77 |
| 资产合计 | - | 381,484,461.09 | - | 381,484,461.09 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 381,484,461.09 | - | 381,484,461.09 |
| 项目 | 上年度末 | | | |
| | 2017 年 12 月 31 日 | | | |
| | 美元 | 港币 | 其他币种 | 合计 |

| | 折合人民币 | 折合人民币 | 折合人民币 | |
|---------------|-------|----------------|-------|----------------|
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 747,536,395.28 | - | 747,536,395.28 |
| 应收股利 | - | - | - | - |
| 资产合计 | - | 747,536,395.28 | - | 747,536,395.28 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 747,536,395.28 | - | 747,536,395.28 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| | | | |
|----|---|-----------------------------------|-------------------------|
| 假设 | 1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变,且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。 | | |
| | 2. 以下汇率敏感性分析不包含远期外汇敞口对应的影响金额。 | | |
| 分析 | 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 6 月 30 日) | 上年度末 (2017 年 12 月 31 日) |
| | 港币相对人民币升值 5% | 19,074,223.05 | 37,376,819.76 |
| | 港币相对人民币贬值 5% | -19,074,223.05 | -37,376,819.76 |

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018 年 6 月 30 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 | 380,317,890.32 | 89.26 | 747,536,395.28 | 86.72 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | - | - | - | - |
| 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 | 380,317,890.32 | 89.26 | 747,536,395.28 | 86.72 |

注：本基金股票资产不低于基金资产的 80%，其中投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如表。

6.4.13.4.3.2 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。 | | |
| 分析 | 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 6 月 30 日） | 上年度末（2017 年 12 月 31 日） |
| | 沪深 300 指数上涨 5% | 21,216,208.68 | 35,898,469.09 |
| | 沪深 300 指数下跌 5% | -21,216,208.68 | -35,898,469.09 |

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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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 | 380,317,890.32 | 88.67 |
| | 其中：股票 | 380,317,890.32 | 88.67 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 44,103,293.47 | 10.28 |
| 8 | 其他各项资产 | 4,507,899.92 | 1.05 |
| 9 | 合计 | 428,929,083.71 | 100.00 |

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 380,317,890.32 元，占期末净值比例 89.26%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票投资。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例 (%) |
|--------|------------|---------------|
| A 基础材料 | 538,235.04 | 0.13 |

| | | |
|-----------|----------------|-------|
| B 消费者非必需品 | 94,177,381.05 | 22.10 |
| C 消费者常用品 | 47,718,406.13 | 11.20 |
| D 能源 | 23,049,510.90 | 5.41 |
| E 金融 | 21,484,059.68 | 5.04 |
| F 医疗保健 | 95,565,569.80 | 22.43 |
| G 工业 | 9,896,307.80 | 2.32 |
| H 信息技术 | 83,672,919.92 | 19.64 |
| I 电信服务 | - | - |
| J 公用事业 | 577,354.88 | 0.14 |
| K 房地产 | 3,638,145.12 | 0.85 |
| 合计 | 380,317,890.32 | 89.26 |

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-------|------------|------------|---------------|--------------|
| 1 | 01093 | 石药集团 | 2,000,000 | 39,962,940.00 | 9.38 |
| 2 | 01293 | 广汇宝信 | 13,411,000 | 34,033,510.44 | 7.99 |
| 3 | 02319 | 蒙牛乳业 | 1,360,000 | 30,499,985.60 | 7.16 |
| 4 | 00268 | 金蝶国际 | 4,166,000 | 28,204,207.44 | 6.62 |
| 5 | 00981 | 中芯国际 | 3,186,500 | 27,402,689.13 | 6.43 |
| 6 | 01177 | 中国生物制药 | 2,278,500 | 23,128,880.33 | 5.43 |
| 7 | 00386 | 中国石油化工股份 | 3,900,000 | 23,049,510.90 | 5.41 |
| 8 | 00839 | 中教控股 | 2,020,000 | 22,480,418.40 | 5.28 |
| 9 | 01398 | 工商银行 | 4,316,000 | 21,359,871.05 | 5.01 |
| 10 | 00700 | 腾讯控股 | 60,600 | 20,119,974.47 | 4.72 |
| 11 | 01112 | H & H 国际控股 | 377,500 | 17,218,420.53 | 4.04 |
| 12 | 01530 | 三生制药 | 1,060,000 | 15,925,484.52 | 3.74 |
| 13 | 06068 | 睿见教育 | 2,706,000 | 15,627,785.91 | 3.67 |
| 14 | 01513 | 丽珠医药 | 336,167 | 10,656,682.15 | 2.50 |
| 15 | 00175 | 吉利汽车 | 465,000 | 7,978,044.53 | 1.87 |
| 16 | 03888 | 金山软件 | 396,000 | 7,946,048.88 | 1.86 |
| 17 | 02001 | 新高教集团 | 1,135,000 | 6,937,659.13 | 1.63 |
| 18 | 00586 | 海螺创业 | 280,000 | 6,775,151.60 | 1.59 |

| | | | | | |
|----|-------|----------|-----------|--------------|------|
| 19 | 02269 | 药明生物 | 80,000 | 5,891,582.80 | 1.38 |
| 20 | 01966 | 中骏置业 | 1,160,000 | 3,638,145.12 | 0.85 |
| 21 | 01317 | 枫叶教育 | 288,000 | 3,433,372.99 | 0.81 |
| 22 | 01055 | 中国南方航空股份 | 600,000 | 3,121,156.20 | 0.73 |
| 23 | 01569 | 民生教育 | 1,546,000 | 2,554,727.90 | 0.60 |
| 24 | 01169 | 海尔电器 | 50,000 | 1,131,861.75 | 0.27 |
| 25 | 00371 | 北控水务集团 | 160,000 | 577,354.88 | 0.14 |
| 26 | 03993 | 洛阳钼业 | 168,000 | 538,235.04 | 0.13 |
| 27 | 00966 | 中国太平 | 6,000 | 124,188.63 | 0.03 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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 | 00386 | 中国石油化工股份 | 75,816,892.37 | 8.80 |
| 2 | 00388 | 香港交易所 | 52,047,495.19 | 6.04 |
| 3 | 00005 | 汇丰控股 | 40,548,481.20 | 4.70 |
| 4 | 01813 | 合景泰富 | 38,156,599.45 | 4.43 |
| 5 | 01918 | 融创中国 | 37,072,578.87 | 4.30 |
| 6 | 01288 | 农业银行 | 35,876,124.32 | 4.16 |
| 7 | 03968 | 招商银行 | 33,661,534.23 | 3.91 |
| 8 | 02319 | 蒙牛乳业 | 30,177,978.46 | 3.50 |
| 9 | 02007 | 碧桂园 | 28,088,065.71 | 3.26 |
| 10 | 00268 | 金蝶国际 | 27,169,492.21 | 3.15 |
| 11 | 01112 | H & H 国际控股 | 23,392,163.17 | 2.71 |
| 12 | 01398 | 工商银行 | 21,587,370.48 | 2.50 |
| 13 | 01530 | 三生制药 | 21,042,393.73 | 2.44 |
| 14 | 01177 | 中国生物制药 | 21,016,627.21 | 2.44 |
| 15 | 01055 | 中国南方航空股份 | 19,902,198.46 | 2.31 |
| 16 | 03988 | 中国银行 | 19,005,446.22 | 2.20 |
| 17 | 00839 | 中教控股 | 18,637,069.04 | 2.16 |

| | | | | |
|----|-------|--------|---------------|------|
| 18 | 06068 | 睿见教育 | 18,070,012.33 | 2.10 |
| 19 | 01030 | 新城发展控股 | 16,267,864.42 | 1.89 |
| 20 | 03333 | 中国恒大 | 14,746,435.35 | 1.71 |

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。

7.4.2 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 | 02318 | 中国平安 | 81,112,432.29 | 9.41 |
| 2 | 01398 | 工商银行 | 77,793,052.92 | 9.02 |
| 3 | 00386 | 中国石油化工股份 | 63,265,698.09 | 7.34 |
| 4 | 00700 | 腾讯控股 | 59,779,161.68 | 6.93 |
| 5 | 00371 | 北控水务集团 | 52,903,032.15 | 6.14 |
| 6 | 02018 | 瑞声科技 | 51,272,528.53 | 5.95 |
| 7 | 03988 | 中国银行 | 49,031,489.75 | 5.69 |
| 8 | 00388 | 香港交易所 | 47,232,569.69 | 5.48 |
| 9 | 00005 | 汇丰控股 | 37,228,213.31 | 4.32 |
| 10 | 01813 | 合景泰富 | 35,312,773.31 | 4.10 |
| 11 | 01288 | 农业银行 | 33,284,309.30 | 3.86 |
| 12 | 01114 | BRILLIANCE CHI | 32,986,228.61 | 3.83 |
| 13 | 01918 | 融创中国 | 32,786,513.92 | 3.80 |
| 14 | 01336 | 新华保险 | 31,442,226.72 | 3.65 |
| 15 | 03968 | 招商银行 | 30,101,740.61 | 3.49 |
| 16 | 00272 | 瑞安房地产 | 29,771,061.02 | 3.45 |
| 17 | 02007 | 碧桂园 | 27,585,383.06 | 3.20 |
| 18 | 01513 | 丽珠医药 | 24,579,851.59 | 2.85 |
| 19 | 00981 | 中芯国际 | 24,052,443.07 | 2.79 |
| 20 | 00175 | 吉利汽车 | 21,654,296.09 | 2.51 |

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。

7.4.3 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 | 764,359,154.60 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,087,135,238.01 |

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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。

7.10 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投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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 | 30,599.19 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,118,226.12 |
| 3 | 应收股利 | 1,802,265.17 |
| 4 | 应收利息 | 9,453.20 |
| 5 | 应收申购款 | 547,356.24 |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,507,899.92 |

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 |
| 13,672 | 24,907.82 | 128,298,687.84 | 37.68% | 212,241,002.07 | 62.32% |

8.2 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 | 319,351.64 | 0.0938% |

8.3 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的情况

| 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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016年7月27日）基金份额总额 | 408,053,169.08 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 655,987,716.67 |
| 本报告期基金总申购份额 | 264,076,938.50 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 579,524,965.26 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 340,539,689.91 |

注：表内“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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》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》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》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. 《汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
5. 《汇添富行业整合主题混合型证券投资基金基金合同》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。
6. 《汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，陈健玮先生和劳杰男先生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，与陈加荣先生共同管理该基金。
8. 基金管理人 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，增聘郑慧莲女士担任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》于 2018 年 3 月 8 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。
11. 基金管理人于 2018 年 3 月 20 日公告，增聘赵鹏飞先生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，与陈加荣先生、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》于 2018 年 3 月 23 日正式生效，吴振翔先生和许一尊先生任该基金的基金经理。
13. 基金管理人于 2018 年 4 月 3 日公告，增聘郑慧莲女士担任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》于 2018 年 4 月 16 日正式生效，吴江宏先生和胡娜女士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》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》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，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。
18. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 30 天债券型证券

投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

19. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

20. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，徐寅喆女士不再担任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理，增聘陶然先生担任该基金的基金经理，由陶然先生单独管理该基金。

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

22. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，徐寅喆女士不再担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，增聘陶然先生担任该基金的基金经理，由陶然先生单独管理该基金。

23. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，增聘徐寅喆女士担任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。

24. 基金管理人 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。

25. 《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》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。

26. 基金管理人 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。

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

28. 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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | 21,325,940,250.66 | 71.61% | 1,284,444.32 | 74.44% | - |
| 川财证券 | 2 | 138,493,893.30 | 7.48% | 138,494.70 | 8.03% | - |
| 太平洋证券 | 2 | 109,685,150.54 | 5.92% | 108,751.67 | 6.30% | - |
| 东吴证券 | 2 | 73,988,543.73 | 4.00% | 73,988.88 | 4.29% | - |
| 西部证券 | 2 | 51,401,456.67 | 2.78% | 41,121.04 | 2.38% | - |
| 华泰证券 | 2 | 43,365,187.75 | 2.34% | 13,009.50 | 0.75% | - |
| 海通证券 | 2 | 42,497,417.02 | 2.30% | 12,749.09 | 0.74% | - |
| 申万宏源证券 | 2 | 36,473,260.14 | 1.97% | 29,178.66 | 1.69% | - |
| 中信证券 | 2 | 29,649,232.80 | 1.60% | 23,719.38 | 1.37% | - |
| 国金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |

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。

10.7.2 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 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |

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：

本基金本报告期内新增 2 家证券公司的 3 个交易单元：海通证券（深交所单元）、华泰证券（上交

所单元和深交所单元)。

10.8 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 年 1 月 2 日 |
| 2 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加南洋商业银行为代销机构的公告 | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2018 年 1 月 19 日 |
| 3 | 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 年 1 月 22 日 |
| 4 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加云湾投资为代销机构的公告 | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2018 年 2 月 10 日 |
| 5 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为代销机构的公告 | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2018 年 2 月 10 日 |
| 6 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京农商银行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 年 3 月 1 日 |
| 7 | 汇添富沪港深新价值股票型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 年 3 月 3 日 |
| 8 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加恒天明泽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 年 3 月 19 日 |
| 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 年 3 月 24 日 |
| 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 年 3 月 28 日 |
| 11 | 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 年 3 月 30 日 |
| 12 | 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 年 3 月 30 日 |

| | | | |
|----|--|--------------------------------|-----------------|
| 13 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加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 年 3 月 31 日 |
| 14 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加蚂蚁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 年 4 月 3 日 |
| 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 年 4 月 9 日 |
| 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 年 4 月 19 日 |
| 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 年 4 月 21 日 |
| 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 年 4 月 23 日 |
| 19 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加长量基金为代销机构的公告 | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站 | 2018 年 5 月 9 日 |
| 20 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加杭州银行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 年 5 月 16 日 |
| 21 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加洪泰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 年 6 月 30 日 |
| 22 | 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 年 6 月 30 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|---------------------------------|----------------|---------------|----------------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2018 年 6 月 5 日至 2018 年 6 月 30 日 | 39,713,264.50 | 37,452,434.46 | 0.00 | 77,165,698.96 | 22.66% |
| | 2 | 2018 年 2 月 27 日至 2018 年 5 月 2 日 | 129,752,371.92 | 0.00 | 129,752,371.92 | 0.00 | 0.00% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值

造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪港深新价值股票型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、报告期内汇添富沪港深新价值股票型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。

12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 19-22 层 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2018 年 8 月 25 日