

# 汇添富盈润混合型证券投资基金 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

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6</b>  |
| 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.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>12</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 12        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 16        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 16        |
| 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.....             | 16        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 17        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 18        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 19        |
| 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.....       | 19        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>20</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 20        |
| 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..... | 20        |
| 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.....      | 20        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>21</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 21        |
| 6.2 利润表.....                                 | 22        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 23        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 24        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 43        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 43        |
| 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.....     | 44        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 44        |
| 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.....    | 46        |
| 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..... | 46        |
| 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..... | 46        |
| 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.....    | 46        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 47        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 47        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 47        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>49</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 49        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 49        |
| 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.....     | 49        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>50</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>51</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 51        |
| 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.....      | 51        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 52        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 52        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 52        |
| 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.....         | 53        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 53        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 55        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>57</b> |
| 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.....    | 57        |

|                          |           |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 57        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>   | <b>58</b> |
| 12.1 备查文件目录.....         | 58        |
| 12.2 存放地点.....           | 58        |
| 12.3 查阅方式.....           | 58        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 汇添富盈润混合型证券投资基金   |                 |
| 基金简称            | 添富盈润混合           |                 |
| 基金主代码           | 004946           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2017 年 9 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           | 中国建设银行股份有限公司     |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 116,563,771.95 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称:    | 添富盈润混合 A         | 添富盈润混合 C        |
| 下属分级基金的交易代码:    | 004946           | 004947          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 105,297,165.86 份 | 11,266,606.09 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。  |
| 投资策略   | 本基金在保证资产配置符合基金合同规定的前提下，采用 CPPI (Constant Proportion Portfolio Insurance) 恒定比例组合保险策略来实现本金保值和增值的目标。CPPI 策略主要根据市场的波动来调整、修正风险类资产的风险乘数，以确保投资组合在一段时间以后的价值不低于事先设定的某一目标价值，从而达到投资组合保值增值的目的。投资过程中，基金管理人将在风险类资产投资风险加大和收益增强这两者之间寻找适当的平衡点，即确定适当的风险乘数，力求既能够保证投资组合风险可控，又能够尽量地为投资者创造更多收益。本基金的投资策略主要包含资产配置策略、债券投资策略和股票投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*20%+中债综合指数收益率*80%  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金，属于中等收益风险特征的基金。  |

### 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           |
|         | 联系电话          | 021-28932888 |
|         |               | 田青           |
|         |               | 010-67595096 |

|        |      |                                    |                      |
|--------|------|------------------------------------|----------------------|
|        | 电子邮箱 | service@99fund.com                 | tianqing1.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

| 基金级别          | 添富盈润混合 A                    | 添富盈润混合 C                    |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 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) | 报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日) |
| 本期已实现收益       | 13,170,753.02               | 1,032,541.62                |
| 本期利润          | 4,530,181.63                | 83,921.75                   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0316                      | 0.0064                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.94%                       | 0.60%                       |
| 本期基金份额净值增长率   | -1.13%                      | -1.53%                      |
| 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      | 4,776,287.62                | 419,714.93                  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0454                      | 0.0373                      |
| 期末基金资产净值      | 110,073,453.48              | 11,686,321.02               |
| 期末基金份额净值      | 1.0454                      | 1.0373                      |
| 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   | 4.54%                       | 3.73%                       |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

#### 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

添富盈润混合 A

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | -1.17%   | 0.50%       | -1.26%     | 0.25%         | 0.09% | 0.25% |



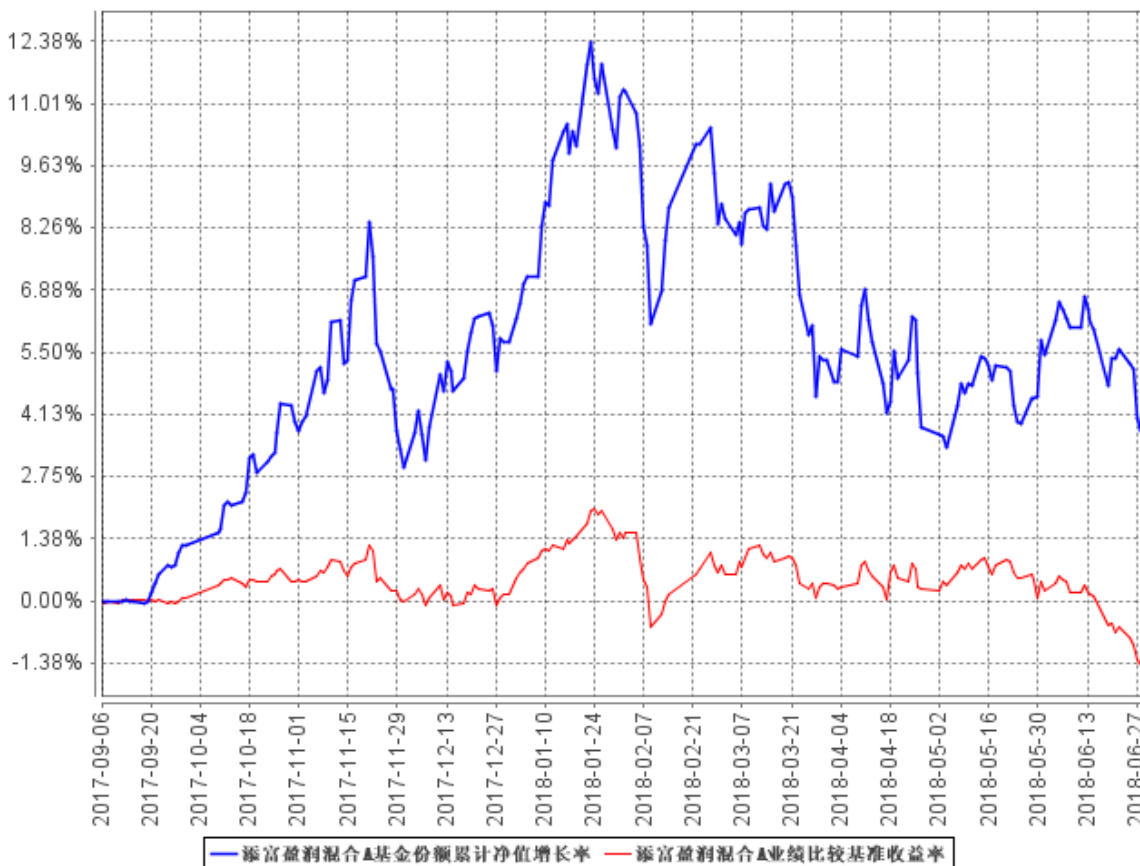
|                     |        |       |        |       |        |       |
|---------------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月               | -0.75% | 0.55% | -1.18% | 0.23% | 0.43%  | 0.32% |
| 过去六个月               | -1.13% | 0.64% | -0.85% | 0.23% | -0.28% | 0.41% |
| 自基金合同<br>生效日起至<br>今 | 4.54%  | 0.59% | -0.83% | 0.20% | 5.37%  | 0.39% |

添富盈润混合 C

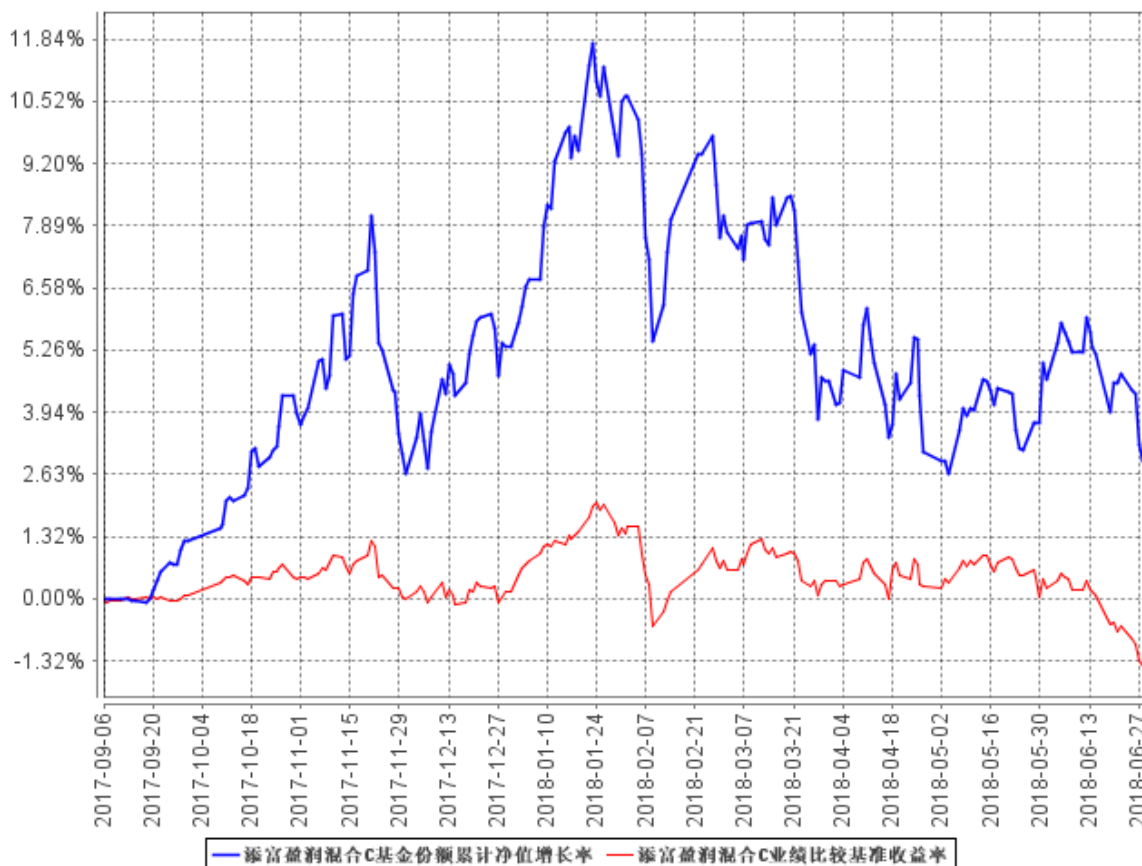
| 阶段                  | 份额净值增<br>长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|---------------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去一个月               | -1.21%       | 0.50%               | -1.26%             | 0.25%                 | 0.05%  | 0.25% |
| 过去三个月               | -0.84%       | 0.55%               | -1.18%             | 0.23%                 | 0.34%  | 0.32% |
| 过去六个月               | -1.53%       | 0.64%               | -0.85%             | 0.23%                 | -0.68% | 0.41% |
| 自基金合同<br>生效日起至<br>今 | 3.73%        | 0.58%               | -0.83%             | 0.20%                 | 4.56%  | 0.38% |

### 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

添富盈润混合A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



添富盈润混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2017 年 09 月 06 日，截至本报告期末，基金成立未满一年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017 年 09 月 06 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

## § 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、汇添富医药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 |        |   |
| 何旻 | 汇添富安心中国债券基金、汇添富6月红定期开放债券基金、汇添富盈鑫保本混合基金、汇添富美元债债券（QDII）基金、添富添福吉祥混合基金、添富盈润混合基金、汇添富弘安混合基金的基金经理。 | 2017年9月6日       | -    | 20年    | 国籍：中国。学历：英国伦敦政治经济学院金融经济学硕士。相关业务资格：基金从业资格、特许金融分析师（CFA），财务风险经理人（FRM）。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司行业研究员、综合研究小组负责人、基金经理助理，固定收益部负责人；金元比联基金管理有限公司基金经理。2004年10月28日至2006年11月11日担任国泰金龙债券基金的基金经理，2005年10月27日至2006年11月11日担任国泰金象保本基金的基金经理，2006年4月28日至2006年11月11日担任国泰金鹿保本基金的基金经理。2007年8月15日至2010年12月29日担任金元比联宝石动力双利债券基金的基金经理，2008年9月3日至2009年3月10日担任金元比联成长动力混合基金的基金经理，2009年3月29日至2010年12月29日担任金元比联丰利债券基金的基金经理。2011年1月加入汇添富资产管理（香港）有限公司，2012年2月17日至今任汇添富人民币债券基金的基金经理。2012年8月加 |

|     |  |                 |   |     |  |
|-----|--|-----------------|---|-----|--|
|     |  |                 |   |     | 入汇添富基金管理股份有限公司，2013 年 11 月 22 日至今任汇添富安心中国债券基金的基金经理，2014 年 1 月 21 日至今任汇添富 6 月红定期开放债券基金（原汇添富信用债债券基金）的基金经理，2016 年 3 月 11 日至今任汇添富盈鑫保本混合基金的基金经理，2017 年 4 月 20 日至今任汇添富美元债债券（QDII）基金的基金经理，2017 年 7 月 24 日至今任添富添福吉祥混合基金的基金经理，2017 年 9 月 6 日至今任添富盈润混合基金的基金经<br>理, 2017 年 9 月 29 日至今任汇添富弘安混合基金的基金经理。 |
| 胡昕炜 | 汇添富消费行业混合基金、添富添福吉祥混合基金、添富盈润混合基金、添富价值创造定开混合基金的基金经理。 | 2017 年 9 月 20 日 | - | 7 年 | 国籍：中国。学历：清华大学工学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年加入汇添富基金任行业分析师。2016 年 4 月 8 日至今任汇添富消费行业混合基金的基金经理，2017 年 7 月 28 日至今任添富添福吉祥混合基金的基金经理，2017 年 9 月 20 日至今任添富盈润混合基金的基金经理，2018 年 1 月 19 日至今任添富价值创造定开混合基金的基金经理。  |

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 年上半年消费物价指数 CPI 基本运行在低位，仅在春节期间反弹至 2.90%。去除了食品和能源价格之后的核心 CPI 在 2.0%上下窄幅波动，6 月核心 CPI 回落至 1.90%，为自 2017 年 3 月



以来的低点。上半年的生产物价指数 PPI 呈现 U 形趋势，在 3 月份达到最低点 3.10% 后开始反弹，在 6 月份达到 4.70%。这一趋势与中国制造业采购经理指数 PMI 指数趋势方向基本一致。PMI 指数最低点出现在 2 月份，4-6 月份亦有所反弹，其中的生产分项指数和新订单指数都呈现上升趋势。宏观基本面数据在今年第一季度有回暖趋势，在第二季度回落。投资数据方面，固定资产投资、房地产投资和基础设施建设投资都呈现了 N 型走势，同比增速在 2、3 月份达到上半年高点后，在二季度都有所回落。民间固定资产投资和制造业投资累计同比增速在 6 月份出现反弹。从房地产的细项数据上看，70 个大中城市商品房价格指数基本保持平稳。销售额、销售面积和新开工面积的累计增速在二季度逐月上升，呈现回暖的趋势。货币政策方面，央行通过公开市场操作在第一季度回笼 9600 亿元，第二季度投放货币 3400 亿元。M1 同比增速在二季度仍然在下降，6 月份增速为近三年来的低点。M2 同比增速仍然在低位徘徊。整个债券市场在上半年呈现资金宽松的局面，只是在 5 月底短暂出现资金紧张局面。人民币兑美元汇率在第二季度走势与第一季度相反，出现贬值。至 6 月底，人民币兑美元汇率基本与去年 12 月底汇率持平。第二季度各月份的外汇占款增加额较第一季度有所上升，在 5 月份达到 91 亿元。

上半年，债券市场受到降准政策的刺激、经济基本面的预期，以及资金面宽松等因素的影响，中债综合财富指数上涨 3.87%。月度表现上，每个月都是正回报，呈现单边上扬的格局。股票市场，上半年沪深 300 指数下跌 12.90%。指数在 1 月 26 日创出近 2 年多来的新高后，逐级回落，在 6 月 28 日创出近 1 年多来的新低。

本基金在上半年，第一季度主要是对股票进行了结构调整，第二季度降低了股票的整体比例。债券方面主要是增加组合的杠杆，买入了中等期限的公司债或者中票，卖出组合中资质较低的信用债。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末添富盈润混合 A 基金份额净值为 1.0454 元，本报告期基金份额净值增长率为 -1.13%；截至本报告期末添富盈润混合 C 基金份额净值为 1.0373 元，本报告期基金份额净值增长率为 -1.53%；同期业绩比较基准收益率为 -0.85%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年下半年经济增长仍然面临一定的不确定性，一方面是去杠杆带来的信用收缩，另一方面因贸易战带来的外需走弱。在一系列监管政策的影响下，实体去杠杆取得了成效，但也同时带来了经济增长的下行压力。去杠杆的负面影响已经开始显现。6 月底召开的央行二季度货币政策例

会中，央行提出“把握好结构性去杠杆的力度和节奏”。从宏观看来，目前社融余额增速已经接近名义 GDP 增速，继续降低可能会使得实体合理融资需求无法获得满足，与年初设定的“保持信贷和社会融资规模合理增长”目标相悖，陷入紧缩式去杠杆的境地。从微观看来，企业再融资成本和压力快速上升，使得信用紧缩成为当前经济下行的主要风险。中美贸易战已经开始，意味着外需对经济拉动能力将进一步走弱。17 年净出口对国内 GDP 的贡献度达到 0.6 个百分点，为近年来的最高值，全球经济的同步复苏是外需改善的主要原因。但 18 年以来，同步复苏正向着复苏分化的状态转变，仅有美国保持良好的增长态势，欧元区景气度开始明显放缓，新兴市场面临较大的资本外流压力。美国经济的“一枝独秀”意味着其开始成为全球需求的主要来源，而特朗普政府的贸易保护主张则恰恰仰仗于这种优势，随着中美贸易战的正式开打，下半年外需对国内经济的拉动作用将会逐步下降。

紧信用带来经济下行叠加外需走弱，我们预期经济政策都将发生变化。国内的信用环境不佳，继续恶化空间有限，紧信用的政策底或已出现；货币政策基调进一步转向宽松，央行第二季度两次降准试图改善银行体系的信贷投放能力；除此，央行将降准释放的约 5000 亿的流动性用于“债转股”，以促进地方国企降低负债率。外部政策方面，我们预计央行对汇率波动的容忍度或增加，以对冲加征关税的影响。总体，今后政策组合拳将由“稳信用”、“宽货币”、“债转股”去杠杆、地方政府债务化解和人民币汇率小幅贬值组成。预计宽松的资金面带来短端收益率下降，宏观经济的压力仍然利好债券收益率的继续下行，预计年内收益率中枢仍有继续向下的空间。对信用债而言，未来不同评级债券间的信用利差将继续走阔。

#### 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：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自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。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该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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：汇添富盈润混合型证券投资基金

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<br>2018 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 408,480.89                     | 1,951,987.59                     |
| 结算备付金           |            | 999,383.65                     | 2,310,523.32                     |
| 存出保证金           |            | 51,541.76                      | 75,240.61                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 119,430,644.47                 | 363,870,286.48                   |
| 其中：股票投资         |            | 25,607,366.16                  | 112,614,398.38                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 93,823,278.31                  | 251,255,888.10                   |
| 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         |            | -                              | 3,091,148.74                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 2,229,432.66                   | 2,224,050.54                     |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 64,183.10                      | 127,893.43                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 123,183,666.53                 | 373,651,130.71                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 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       |            | 1,000,000.00                   | 21,000,000.00                    |
| 应付证券清算款         |            | 797.26                         | -                                |
| 应付赎回款           |            | 45,300.73                      | 3,384,182.33                     |
| 应付管理人报酬         |            | 103,817.16                     | 324,239.63                       |
| 应付托管费           |            | 25,954.31                      | 81,059.91                        |
| 应付销售服务费         |            | 3,904.14                       | 8,401.01                         |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 33,720.76                      | 246,972.14                       |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应交税费          |          | 7,011.61       | -              |
| 应付利息          |          | -265.76        | -7,883.40      |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 203,651.82     | 208,470.51     |
| 负债合计          |          | 1,423,892.03   | 25,245,442.13  |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 116,563,771.95 | 329,608,543.12 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 5,196,002.55   | 18,797,145.46  |
| 所有者权益合计       |          | 121,759,774.50 | 348,405,688.58 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 123,183,666.53 | 373,651,130.71 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，其中下属 A 类基金份额参考净值 1.0454 元，份额总额 105,297,165.86 份；下属 C 类基金份额参考净值 1.0373 元，份额总额 11,266,606.09 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富盈润混合型证券投资基金

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<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月<br>30 日 |
|-----------------------|------------|--|
| <b>一、收入</b>           |            | 6,390,673.96                             |
| 1.利息收入                |            | 2,034,381.10                             |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 25,367.50                                |
| 债券利息收入                |            | 2,009,013.60                             |
| 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）      |            | 13,442,826.61                            |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 15,466,910.20                            |
| 基金投资收益                |            | -  |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | -2,515,177.81                            |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.2 | -  |
| 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   | 491,094.22                               |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -9,589,191.26                            |
| 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   | 502,657.51                               |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 1,776,570.58                             |

|                            |            |                     |
|----------------------------|------------|---------------------|
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 831,150.02          |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 207,787.56          |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 27,555.74           |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 194,856.03          |
| 5. 利息支出                    |            | 321,343.43          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 321,343.43          |
| 6. 税金及附加                   |            | 5,354.37            |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 188,523.43          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>4,614,103.38</b> |

注：本基金合同于 2017 年 09 月 06 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示本期数据，特此说明。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富盈润混合型证券投资基金

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<br>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）                        | 329,608,543.12                        | 18,797,145.46  | 348,405,688.58  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 4,614,103.38   | 4,614,103.38    |
| 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）      | -213,044,771.17                       | -18,215,246.29 | -231,260,017.46 |
| 其中：1.基金申购款                             | 18,784,919.75                         | 1,584,190.22   | 20,369,109.97   |
| 2.基金赎回款                                | -231,829,690.92                       | -19,799,436.51 | -251,629,127.43 |
| 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                              | 116,563,771.95                        | 5,196,002.55   | 121,759,774.50  |

|        |  |  |  |
|--------|--|--|--|
| (基金净值) |  |  |  |
|--------|--|--|--|

注：本基金合同于 2017 年 9 月 6 日生效，无比较式的上年可比期间，因此所有者权益（基金净值）变动表只列示本期数据，特此说明。

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

汇添富盈润混合型证券投资基金（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[2017]784 号文《关于准予汇添富盈润混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司于 2017 年 8 月 7 日至 2017 年 9 月 1 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2017)验字第 60466941\_B32 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2017 年 9 月 6 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 646,701,956.42 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 263,325.55 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 646,965,281.97 元，折合 646,965,281.97 份基金份额。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，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货、股票期权、国债期货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）。本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%。



## 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[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，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非

货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 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[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。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。

## 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<br>2018年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 408,480.89        |
| 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：          | 408,480.89        |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2018年6月30日 |                |               |               |
|-------------------|-------------------|----------------|---------------|---------------|
|                   | 成本                | 公允价值           | 公允价值变动        |               |
| 股票                | 22,280,278.84     | 25,607,366.16  | 3,327,087.32  |               |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                 | -              | -             |               |
| 债券                | 交易所市场             | 74,805,212.17  | 73,766,278.31 | -1,038,933.86 |
|                   | 银行间市场             | 19,978,701.23  | 20,057,000.00 | 78,298.77     |
|                   | 合计                | 94,783,913.40  | 93,823,278.31 | -960,635.09   |
| 资产支持证券            | -                 | -              | -             |               |
| 基金                | -                 | -              | -             |               |
| 其他                | -                 | -              | -             |               |
| 合计                | 117,064,192.24    | 119,430,644.47 | 2,366,452.23  |               |

### 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<br>2018年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 629.14            |
| 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  | 449.70            |
| 应收债券利息     | 2,228,330.45      |
| 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    | 0.17              |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 23.20             |
| 合计         | 2,229,432.66      |

注：“其他”为应收结算保证金利息。

**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<br>2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 33,720.76         |
| 银行间市场应付交易费用 | -                 |
| 合计          | 33,720.76         |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 6.10              |
| 应付信息披露费     | 159,014.74        |
| 应付审计费       | 44,630.98         |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 203,651.82 |
|----|------------|

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 添富盈润混合 A      |                                       |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>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          | 306,889,428.71                        | 306,889,428.71  |
| 本期申购          | 14,422,282.02                         | 14,422,282.02   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -216,014,544.87                       | -216,014,544.87 |
| - 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           | 105,297,165.86                        | 105,297,165.86  |

金额单位：人民币元

| 添富盈润混合 C      |                                       |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| 项目            | 本期<br>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          | 22,719,114.41                         | 22,719,114.41  |
| 本期申购          | 4,362,637.73                          | 4,362,637.73   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -15,815,146.05                        | -15,815,146.05 |
| - 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           | 11,266,606.09                         | 11,266,606.09  |

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

| 添富盈润混合 A |                |               |                |
|----------|----------------|---------------|----------------|
| 项目       | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
| 上年度末     | 17,715,517.47  | -131,137.30   | 17,584,380.17  |
| 本期利润     | 13,170,753.02  | -8,640,571.39 | 4,530,181.63   |
| 本期基金份额交易 | -17,001,267.40 | -337,006.78   | -17,338,274.18 |

|          |                |               |                |
|----------|----------------|---------------|----------------|
| 产生的变动数   |                |               |                |
| 其中：基金申购款 | 1,414,458.98   | -138,519.01   | 1,275,939.97   |
| 基金赎回款    | -18,415,726.38 | -198,487.77   | -18,614,214.15 |
| 本期已分配利润  | -              | -             | -              |
| 本期末      | 13,885,003.09  | -9,108,715.47 | 4,776,287.62   |

单位：人民币元

| 添富盈润混合 C       |               |             |               |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分       | 未分配利润合计       |
| 上年度末           | 1,220,044.23  | -7,278.94   | 1,212,765.29  |
| 本期利润           | 1,032,541.62  | -948,619.87 | 83,921.75     |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -866,298.38   | -10,673.73  | -876,972.11   |
| 其中：基金申购款       | 441,772.31    | -133,522.06 | 308,250.25    |
| 基金赎回款          | -1,308,070.69 | 122,848.33  | -1,185,222.36 |
| 本期已分配利润        | -             | -           | -             |
| 本期末            | 1,386,287.47  | -966,572.54 | 419,714.93    |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 11,435.77                  |
| 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 | 13,131.05                  |
| 其他        | 800.68                     |
| 合计        | 25,367.50                  |

注：其中“其他”为直销申购款利息收入和交易保证金利息收入。

#### 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<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 94,515,783.67              |
| 减：卖出股票成本总额 | 79,048,873.47              |
| 买卖股票差价收入   | 15,466,910.20              |

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 189,431,617.33             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 189,722,355.79             |
| 减：应收利息总额                | 2,224,439.35               |
| 买卖债券差价收入                | -2,515,177.81              |

**6.4.7.13.2 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<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 491,094.22                 |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 491,094.22                 |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -9,589,191.26              |
| ——股票投资     | -11,888,295.49             |
| ——债券投资     | 2,299,104.23               |
| ——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<br>增值税 | -             |
| 合计                         | -9,589,191.26 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 502,657.51                 |
| 其他收入    | -                          |
| 合计      | 502,657.51                 |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 194,681.03                 |
| 银行间市场交易费用 | 175.00                     |
| 合计        | 194,856.03                 |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>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 | 119,014.74                 |
| 账户维护费 | 18,600.00                  |
| 银行划款费 | 6,277.71                   |
| 合计    | 188,523.43                 |

## 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、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 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：以下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<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                  |
|------------|----------------------------|------------------|
|            | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 东方证券股份有限公司 | 98,237,286.67              | 100.00%          |

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 |

|            |                |         |
|------------|----------------|---------|
| 东方证券股份有限公司 | 194,050,190.52 | 100.00% |
|------------|----------------|---------|

### 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<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                    |
|------------|----------------------------|--------------------|
|            | 回购成交金额                     | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 |
| 东方证券股份有限公司 | 1,830,000,000.00           | 100.00%            |

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

### 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<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                |           |                  |
|----------------|----------------------------|----------------|-----------|------------------|
|                | 当期佣金                       | 占当期佣金总<br>量的比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 东方证券股份有限<br>公司 | 90,640.30                  | 100.00%        | 33,720.76 | 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<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 831,150.02                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 519,607.41                 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提, 逐日累计至每个月月末, 按月支付, 由基金管理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。

#### 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 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 207,787.56                      |

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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                              |           |           |
|----------------|---------------------------------|-----------|-----------|
|                | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |           |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |           |           |
|                | 添富盈润混合 A                        | 添富盈润混合 C  | 合计        |
| 中国建设银行股份有限公司   | -                               | 16,811.47 | 16,811.47 |
| 汇添富基金管理股份有限公司  | -                               | 4,189.61  | 4,189.61  |
| 合计             | -                               | 21,001.08 | 21,001.08 |

注: 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费年率为 0.40%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的资产净值的 0.40% 年费率计提。

计算方法如下:

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金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。

#### 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：本基金本报告期末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：本报告期内基金管理人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<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |           |
|--------------|---------------------------------------|-----------|
|              | 期末余额                                  | 当期利息收入    |
| 中国建设银行股份有限公司 | 408,480.89                            | 11,435.77 |

#### 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：本基金本报告期末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，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 1,000,000.00 元，于 2018 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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。

#### 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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注 6.4.12 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。

### 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、债券投资、结算备付金、存出保证金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<br>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<br>上 | 不计息            | 合计             |
|--------------------------|---------------|---------------|----------------|----------------|-----------|----------------|----------------|
| <b>资产</b>                |               |               |                |                |           |                |                |
| 银行存款                     | 408,480.89    | -             | -              | -              | -         | -              | 408,480.89     |
| 结算备付金                    | 999,383.65    | -             | -              | -              | -         | -              | 999,383.65     |
| 存出保证金                    | 51,541.76     | -             | -              | -              | -         | -              | 51,541.76      |
| 交易性金融资产                  | 10,003,000.00 | -             | 8,508,152.11   | 75,312,126.20  | -         | 25,607,366.16  | 119,430,644.47 |
| 应收利息                     | -             | -             | -              | -              | -         | 2,229,432.66   | 2,229,432.66   |
| 应收申购款                    | 307.65        | -             | -              | -              | -         | 63,875.45      | 64,183.10      |
| 其他资产                     | -             | -             | -              | -              | -         | -              | -              |
| 资产总计                     | 11,462,713.95 | -             | 8,508,152.11   | 75,312,126.20  | -         | 27,900,674.27  | 123,183,666.53 |
| <b>负债</b>                |               |               |                |                |           |                |                |
| 卖出回购金融资产<br>款            | 1,000,000.00  | -             | -              | -              | -         | -              | 1,000,000.00   |
| 应付证券清算款                  | -             | -             | -              | -              | -         | 797.26         | 797.26         |
| 应付赎回款                    | -             | -             | -              | -              | -         | 45,300.73      | 45,300.73      |
| 应付管理人报酬                  | -             | -             | -              | -              | -         | 103,817.16     | 103,817.16     |
| 应付托管费                    | -             | -             | -              | -              | -         | 25,954.31      | 25,954.31      |
| 应付销售服务费                  | -             | -             | -              | -              | -         | 3,904.14       | 3,904.14       |
| 应付交易费用                   | -             | -             | -              | -              | -         | 33,720.76      | 33,720.76      |
| 应付利息                     | -             | -             | -              | -              | -         | -265.76        | -265.76        |
| 应交税费                     | -             | -             | -              | -              | -         | 7,011.61       | 7,011.61       |
| 其他负债                     | -             | -             | -              | -              | -         | 203,651.82     | 203,651.82     |
| 负债总计                     | 1,000,000.00  | -             | -              | -              | -         | 423,892.03     | 1,423,892.03   |
| 利率敏感度缺口                  | 10,462,713.95 | -             | 8,508,152.11   | 75,312,126.20  | -         | 27,476,782.24  | 121,759,774.50 |
| 上年度末<br>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<br>上 | 不计息            | 合计             |
| <b>资产</b>                |               |               |                |                |           |                |                |
| 银行存款                     | 1,951,987.59  | -             | -              | -              | -         | -              | 1,951,987.59   |
| 结算备付金                    | 2,310,523.32  | -             | -              | -              | -         | -              | 2,310,523.32   |
| 存出保证金                    | 75,240.61     | -             | -              | -              | -         | -              | 75,240.61      |
| 交易性金融资产                  | -             | 10,982,000.00 | 115,980,867.60 | 124,293,020.50 | -         | 112,614,398.38 | 363,870,286.48 |
| 应收证券清算款                  | -             | -             | -              | -              | -         | 3,091,148.74   | 3,091,148.74   |
| 应收利息                     | -             | -             | -              | -              | -         | 2,224,050.54   | 2,224,050.54   |
| 应收申购款                    | 49.94         | -             | -              | -              | -         | 127,843.49     | 127,893.43     |
| 其他资产                     | -             | -             | -              | -              | -         | -              | -              |
| 资产总计                     | 4,337,801.46  | 10,982,000.00 | 115,980,867.60 | 124,293,020.50 | -         | 118,057,441.15 | 373,651,130.71 |
| <b>负债</b>                |               |               |                |                |           |                |                |
| 卖出回购金融资产                 | 21,000,000.00 | -             | -              | -              | -         | -              | 21,000,000.00  |



|         |                |               |                |                |   |                 |                |
|---------|----------------|---------------|----------------|----------------|---|-----------------|----------------|
| 款       |                |               |                |                |   |                 |                |
| 应付赎回款   | -              | -             | -              | -              | - | 3,384,182.33    | 3,384,182.33   |
| 应付管理人报酬 | -              | -             | -              | -              | - | 324,239.63      | 324,239.63     |
| 应付托管费   | -              | -             | -              | -              | - | 81,059.91       | 81,059.91      |
| 应付销售服务费 | -              | -             | -              | -              | - | 8,401.01        | 8,401.01       |
| 应付交易费用  | -              | -             | -              | -              | - | 246,972.14      | 246,972.14     |
| 应付利息    | -              | -             | -              | -              | - | -7,883.40       | -7,883.40      |
| 其他负债    | -              | -             | -              | -              | - | 208,470.51      | 208,470.51     |
| 负债总计    | 21,000,000.00  | -             | -              | -              | - | 4,245,442.13    | 25,245,442.13  |
| 利率敏感度缺口 | -16,662,198.54 | 10,982,000.00 | 115,980,867.60 | 124,293,020.50 | - | -113,811,999.02 | 348,405,688.58 |

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

|               |  |                             |                        |
|---------------|--|-----------------------------|------------------------|
| 假设            | 1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；  |                             |                        |
|               | 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；  |                             |                        |
|               | 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；   |                             |                        |
|               | 4. 银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。 |                             |                        |
| 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） |
|               | 基准利率增加 25 个基点  | -281,419.41                 | -1,367,578.91          |
| 基准利率减少 25 个基点 | 283,367.93   | 1,380,797.63                |                        |

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 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 其他价格风险的敏感性分析**

注：于 2018 年 6 月 30 日，本基金成立未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### **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              | 25,607,366.16  | 20.79         |
|    | 其中：股票             | 25,607,366.16  | 20.79         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 93,823,278.31  | 76.17         |
|    | 其中：债券             | 93,823,278.31  | 76.17         |
|    | 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      | 1,407,864.54   | 1.14          |
| 8  | 其他各项资产            | 2,345,157.52   | 1.90          |
| 9  | 合计                | 123,183,666.53 | 100.00        |

### 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

金额单位：人民币元

| 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              | 25,607,366.16 | 21.03         |
| 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      | -             | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -             |
| J  | 金融业              | -             | -             |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| K | 房地产业          | -             | -     |
| L | 租赁和商务服务业      | -             | -     |
| M | 科学研究和技术服务业    | -             | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -             | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -     |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 25,607,366.16 | 21.03 |

### 7.2.2 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股票投资。

### 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  | 600519 | 贵州茅台 | 16,001  | 11,704,091.46 | 9.61         |
| 2  | 600887 | 伊利股份 | 369,043 | 10,296,299.70 | 8.46         |
| 3  | 000651 | 格力电器 | 76,500  | 3,606,975.00  | 2.96         |

### 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  | 000651 | 格力电器 | 3,721,503.00 | 1.07           |
| 2  | 600901 | 江苏租赁 | 155,843.75   | 0.04           |
| 3  | 300733 | 西菱动力 | 21,839.70    | 0.01           |
| 4  | 603712 | 七一二  | 18,300.10    | 0.01           |
| 5  | 603356 | 华菱精工 | 12,650.19    | 0.00           |

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  | 000651 | 格力电器 | 30,840,219.09 | 8.85            |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 14,463,765.84 | 4.15            |
| 3  | 601398 | 工商银行 | 12,056,181.63 | 3.46            |
| 4  | 600887 | 伊利股份 | 9,941,967.73  | 2.85            |
| 5  | 000661 | 长春高新 | 7,255,131.50  | 2.08            |
| 6  | 600519 | 贵州茅台 | 6,706,617.24  | 1.92            |
| 7  | 603589 | 口子窖  | 6,151,227.52  | 1.77            |
| 8  | 601601 | 中国太保 | 6,027,834.99  | 1.73            |
| 9  | 600901 | 江苏租赁 | 260,570.75    | 0.07            |
| 10 | 002920 | 德赛西威 | 198,294.60    | 0.06            |
| 11 | 300735 | 光弘科技 | 111,753.16    | 0.03            |
| 12 | 603712 | 七一二  | 105,698.16    | 0.03            |
| 13 | 300664 | 鹏鹞环保 | 87,869.60     | 0.03            |
| 14 | 300733 | 西菱动力 | 52,652.30     | 0.02            |
| 15 | 300684 | 中石科技 | 45,567.70     | 0.01            |
| 16 | 603283 | 赛腾股份 | 44,517.00     | 0.01            |
| 17 | 002923 | 润都股份 | 40,077.54     | 0.01            |
| 18 | 603477 | 振静股份 | 39,158.65     | 0.01            |
| 19 | 002919 | 名臣健康 | 32,634.75     | 0.01            |
| 20 | 603356 | 华菱精工 | 27,643.92     | 0.01            |

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 | 3,930,136.74  |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 94,515,783.67 |

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

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      | 10,003,000.00 | 8.22  |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,003,000.00 | 8.22  |
| 4  | 企业债券      | 67,473,726.20 | 55.42 |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -     |
| 6  | 中期票据      | 10,054,000.00 | 8.26  |
| 7  | 可转债（可交换债） | 6,292,552.11  | 5.17  |
| 8  | 同业存单      | -             | -     |
| 9  | 其他        | -             | -     |
| 10 | 合计        | 93,823,278.31 | 77.06 |

### 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

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  | 101759068 | 17 兴展投资 MTN003 | 100,000 | 10,054,000.00 | 8.26         |
| 2  | 143623    | 18 粤电 01       | 100,000 | 10,005,000.00 | 8.22         |
| 3  | 170410    | 17 农发 10       | 100,000 | 10,003,000.00 | 8.22         |
| 4  | 112605    | 17 光线 01       | 100,000 | 9,939,000.00  | 8.16         |
| 5  | 143323    | 17 首创债         | 100,000 | 9,864,000.00  | 8.10         |

### 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

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

## 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   | 51,541.76    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,229,432.66 |
| 5  | 应收申购款   | 64,183.10    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,345,157.52 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 123002 | 国祯转债 | 2,465,552.11 | 2.02         |
| 2  | 113014 | 林洋转债 | 902,400.00   | 0.74         |

### 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

| 份额级别     | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |        |                |         |
|----------|----------|-----------|-------|--------|----------------|---------|
|          |          |           | 机构投资者 |        | 个人投资者          |         |
|          |          |           | 持有份额  | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例  |
| 添富盈润混合 A | 3,580    | 29,412.62 | 0.00  | 0.00%  | 105,297,165.86 | 100.00% |
| 添富盈润混合 C | 557      | 20,227.30 | 0.00  | 0.00%  | 11,266,606.09  | 100.00% |
| 合计       | 4,137    | 28,175.92 | 0.00  | 0.00%  | 116,563,771.95 | 100.00% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末管理人的从业人员未持有本基金。

### 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                             | 份额级别     | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 添富盈润混合 A | 0                 |
|                                | 添富盈润混合 C | 0                 |
|                                | 合计       | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 添富盈润混合 A | 0                 |
|                                | 添富盈润混合 C | 0                 |
|                                | 合计       | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 添富盈润混合 A       | 添富盈润混合 C      |
|-------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2017 年 9 月 6 日）基金份额总额 | 595,028,460.89 | 51,936,821.08 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 306,889,428.71 | 22,719,114.41 |
| 本报告期基金总申购份额                   | 14,422,282.02  | 4,362,637.73  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 216,014,544.87 | 15,815,146.05 |
| 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                   | 105,297,165.86 | 11,266,606.09 |

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      | 98,237,286.67 | 100.00%      | 90,640.30 | 100.00%    | -  |
| 申万宏源证券 | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 方正证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 太平洋证券  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 联讯证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 东吴证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 海通证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 川财证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中泰证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 华泰证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 西部证券   | 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   | 194,050,190.52 | 100.00% | 1,830,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 申万宏源证券 | -              | -       | -                | -       | - | - |
| 中信证券   | -              | -       | -                | -       | - | - |
| 国金证券   | -              | -       | -                | -       | - | - |
| 方正证券   | -              | -       | -                | -       | - | - |
| 太平洋证券  | -              | -       | -                | -       | - | - |
| 联讯证券   | -              | -       | -                | -       | - | - |
| 东吴证券   | -              | -       | -                | -       | - | - |
| 海通证券   | -              | -       | -                | -       | - | - |
| 川财证券   | -              | -       | -                | -       | - | - |
| 中泰证券   | -              | -       | -                | -       | - | - |
| 华泰证券   | -              | -       | -                | -       | - | - |
| 西部证券   | -              | -       | -                | -       | - | - |

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 |
| 3  | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加天天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 1 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肯特瑞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 3 月 9 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众禄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 3 月 19 日 |
| 7  | 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 |
| 8  | 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 |
| 9  | 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 |
| 10 | 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 |
| 11 | 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 |

|    |  |                                |                 |
|----|--|--------------------------------|-----------------|
| 12 | 汇添富盈润混合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 4 月 20 日 |
| 13 | 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 |
| 14 | 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 |
| 15 | 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

注：无。

### 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盈润混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富盈润混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富盈润混合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、报告期内汇添富盈润混合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](http://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