

汇添富香港优势精选混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 06 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 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。

基金托管人中国工商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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	38
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	40

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	43
7.7 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	43
7.8 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	43
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金融衍生品投资明细	44
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	44
7.11 投资组合报告附注.....	44
§ 8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45
§ 9 开放式基金份额变动.....	45
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件.....	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富香港优势精选混合型证券投资基金
基金简称	汇添富香港优势精选混合(QDII)
基金主代码	470888
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月25日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	199,238,618.74 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在香港证券市场精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的公司股票等证券，通过有效的资产配置和组合管理，进行中长期投资布局，在有效管理风险的前提下，追求持续稳健的较高投资回报。
投资策略	本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出具有持续竞争优势，且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。
业绩比较基准	MSCI 中华指数 (MSCI ZhongHua Index)。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105798
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105799
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大厦 19-22 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	李文	易会满

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	布朗兄弟哈里曼银行
	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
注册地址		140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		NY 10005

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 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

2.6 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01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	24,517,603.61
本期利润	-5,185,952.48
加权平均基金份额本期利润	-0.0208
本期加权平均净值利润率	-1.78%
本期基金份额净值增长率	-1.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配利润	24,823,910.89
期末可供分配基金份额利润	0.1246
期末基金资产净值	224,062,529.63
期末基金份额净值	1.125
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)
基金份额累计净值增长率	27.95%

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

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

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

3.2 基金净值表现

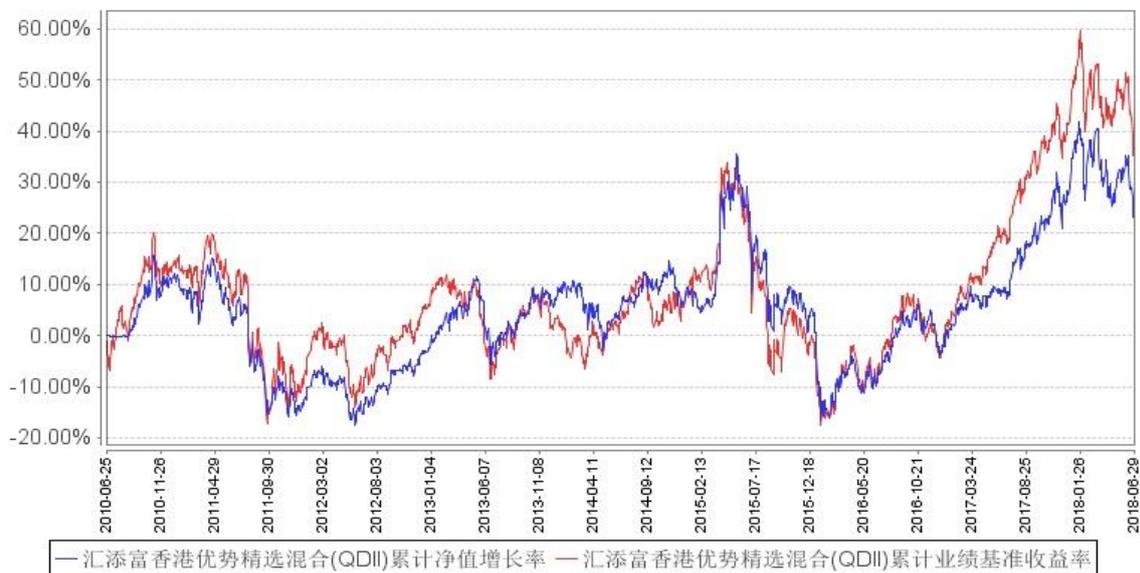
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.43%	1.29%	-5.55%	1.27%	2.12%	0.02%
过去三个月	-2.00%	1.21%	-3.87%	1.07%	1.87%	0.14%
过去六个月	-1.23%	1.30%	-3.00%	1.22%	1.77%	0.08%
过去一年	18.19%	1.14%	15.57%	1.04%	2.62%	0.10%
过去三年	3.11%	1.15%	14.86%	1.16%	-11.75%	-0.01%
自基金合同生效起至今	27.95%	1.02%	38.06%	1.16%	-10.11%	-0.14%

注：本基金的《基金合同》生效日为2010年6月25日。

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

汇添富香港优势精选混合(QDII)累计净值收益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（2010年6月25日）起6个月，建仓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		
倪健	汇添富香港优势精选混合基金、添富港股通专注成长基金的基金经理。	2015 年 10 月 27 日		15 年	国籍：中国，学历：美国哥伦比亚大学公共管理硕士，清华大学工程硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格，特许金融分析师（CFA），财务风险经理人（FRM）。从业经历：曾任中国银河证券有限责任公司投资银行总部、股票发行部业务经理，中信证券国际资产管理（香港）有限公司投资分析员，五矿资本（香港）有限公司投资组合经理。2015 年 9 月加入汇添富基金管理股份有限公司，2015 年 10 月 27 日起任汇添富香港优势精选混合基金的基金经理，2017 年 11 月 10 日至今担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“离任日期”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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年上半年，香港市场先是在年初经历了较快冲高后回落，其后数月区间震荡，在半年末的时候受压继续下跌。对市场最大的压力，还是来自中美贸易摩擦的影响。在此期间，双方高层多次磋商，给市场传递的信号也反复出现变化，使投资者信心在起伏中出现了较大的消耗。目前看来，这个因素还将在较长一段时间里，较为深远地影响国内经济和资本市场。另一方面，中

央对于去杠杆，调结构的决心也是十分坚定。短期内的国内外负面因素干扰并未促使政策有明显的转向趋势，一些资金对放松的预期也有所落空。到了 6 月下旬，随着人民币短期内快速贬值，市场引发了新一轮担忧，叠加上季节性的资金面偏紧因素，市场开始持续下跌并创出了年内新低。流动性层面，虽然港股市场的成交量维持较为活跃的级别，但可以明显感到还是有资金正在离场或者选择避险观望。因此我们在操作上，也在年初市场高点之后，逐步转向较为均衡的配置，并更加注重持仓的安全边际以及是否会受到以上负面因素的影响。

在上半年，国内宏观经济数字出现较大分化，很多具有指标意义的项目，如社融增速、出口、以及基建投资等都不尽如人意，规模以上工业的表观需求量也在高基数背景下增长乏力。我们判断，和投资相关的周期品虽然仍有供给侧改革和环保严控的利好因素，但需求不足的局面仍然是未来持续性的隐忧，在这个领域的配置也相对谨慎。

另一方面，我们看到消费行业中许多板块的需求持续较为旺盛，消费升级和价格上涨带动相关公司的业绩预期提升。在投资和出口受压的情况下，消费是我们预期未来拉动国内经济最稳定也是最有潜力的一个方向。因此我们在组合中也伺机增加了具有品牌竞争力或渠道优势的消费公司比重，期待可以获得中长期一个较为稳定的增长。

目前来看，一些和宏观经济及政策相关度较高的板块，如地产、银行、保险等，虽然受政策等因素基本面不如之前明朗，但也存在预期过度回落，投资价值凸显的可能，现在也是我们重点关注的方向，并已经做出了少量配置。

总体而言，我们在上半年市场波动较大的情况下，整体选股上把握住了部分强势的板块和优质的个股，但外部因素的突发和不确定也冲击到了我们持有的一些中长期看好的持仓，造成短期的波动增加。我们的选股逻辑，还是会基于一个较长的基本面判断，挑选具有竞争力的优质公司，争取为投资者创造稳定而持续的回报。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金上半年收益率为-1.23%，同期基准收益率为-3.00%，超额收益为 1.77%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年下半年，我们认为市场整体仍然可能会是一个相对较为动荡的状态，风险在调整过程中逐步得以消化吸收。我们看到了在目前市场的偏悲观气氛中，一些受坏消息影响的行业和个股估值也回落较快，甚至已经回到了 2016 年市场启动之前的水平，感觉在风险中蕴含着很多新的投资机会。我们希望可以抓住市场波动带来的价值错配机会，在合适的时点去配置组合，对下半年做好准备。当然，在目前的市况下，组合的稳健和安全是投资者的核心利益之一，因此在今年市场变化因素特别多特别频繁的情况下，我们会格外注意组合的均衡稳定，不断根据事件的发

展来对组合进行动态调整。市场情绪变化往往会放大实际基本面的变动，在过度反应时，能够准确分辨机会与价值陷阱，还是需要从实际业务的角度，以谨慎的逻辑进行思考。海外主要市场和国内的流动性仍然是关键的指标，汇率和利率对于香港市场资金的作用将较之前对股市有更大的边际影响，也是我们策略上关注的核心因素。

根据前述基于景气度、成长性和安全边际的行业选择模式，我们将优先配置受宏观因素影响较小，估值安全边际高且业绩有确定成长的标的。关注的重点包括互联网+、新兴消费、医药、环保新能源以及石化相关的板块。另外着眼配置一些实际业绩可能和市场有预期差的公司。还有一些受到短期负面消息压制的优秀公司，我们也关注其长期投资价值和较好的进入点位。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，最少一次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 25%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，汇添富香港优势精选混合型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富香港优势精选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富香港优势精选混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富香港优势精选混合型证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富香港优势精选混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 06 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	42,031,569.56	22,386,169.29
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	177,953,791.48	262,908,574.20
其中：股票投资		177,953,791.48	262,908,574.20
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		4,380,197.60	-
应收利息	6.4.7.5	3,297.09	5,438.28
应收股利		925,032.09	-
应收申购款		291,948.59	575,249.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		225,585,836.41	285,875,431.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06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		15.43	37.27
应付赎回款		846,957.54	248,423.60
应付管理人报酬		303,329.50	376,421.96
应付托管费		56,874.29	70,579.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	114,978.37	132,132.84
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	201,151.65	150,919.34
负债合计		1,523,306.78	978,514.12
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	199,238,618.74	250,064,012.27
未分配利润	6.4.7.10	24,823,910.89	34,832,904.77
所有者权益合计		224,062,529.63	284,896,917.04
负债和所有者权益总计		225,585,836.41	285,875,431.16

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.125 元，基金份额总额 199,238,618.74 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富香港优势精选混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年01月01日至 2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017 年06月30日
一、收入		-1,128,313.25	24,217,619.97
1. 利息收入		93,419.98	115,657.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	93,419.98	115,657.27
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		27,188,611.84	12,339,245.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	24,285,454.10	11,028,462.41
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.14.1	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	2,903,157.74	1,310,782.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-29,703,556.09	12,248,346.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		1,157,673.16	-621,825.55
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	135,537.86	136,196.24
减：二、费用		4,057,639.23	3,125,412.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,321,018.54	1,753,296.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	435,191.02	328,743.18
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	1,116,516.37	963,947.02
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	6.4.7.21	184,913.30	79,425.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,185,952.48	21,092,207.18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富香港优势精选混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06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）	250,064,012.27	34,832,904.77	284,896,917.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-5,185,952.48	-5,185,952.48
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）	-50,825,393.53	-4,823,041.40	-55,648,434.93
其中：1. 基金申购款	62,144,206.67	12,254,218.78	74,398,425.45
2. 基金赎回款	-112,969,600.20	-17,077,260.18	-130,046,860.38
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）	199,238,618.74	24,823,910.89	224,062,529.63
项目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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）	253,315,358.54	-11,601,730.44	241,713,628.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	21,092,207.18	21,092,207.18
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）	-38,236,670.26	1,936,667.76	-36,300,002.50
其中：1. 基金申购	76,615,190.35	1,596,847.96	78,212,038.31

款			
2. 基金赎回款	-114,851,860.61	339,819.80	-114,512,040.81
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)	215,078,688.28	11,427,144.50	226,505,832.78

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：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富香港优势精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），原汇添富香港优势精选股票型证券投资基金，是由汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金转型而来。汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]1221 号文《关于核准汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开发行募集，基金合同于 2010 年 6 月 25 日正式生效，首次设立募集规模为 522,636,079.14 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和注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)。

2014 年 1 月 8 日，汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论通过了关于修改基金名称及投资细节的议案。在基金管理人向中国证监会履行相应备案手续，并经中国证监会书面确认后，基金份额持有人大会决议生效。2014 年 1 月 17 日，中国证监会基金部函[2014]23 号文《关于汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》书面确认后，原《汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金合同》失效，《汇添富香港优势精选股票型证券投资基金基金合同》生效，“汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精

选股票型证券投资基金”更名为“汇添富香港优势精选股票型证券投资基金”，同时基金投资目标、投资范围等投资细节相应调整。根据中国证券监督管理委员会于 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，汇添富基金管理股份有限公司决定自 2015 年 8 月 5 日起将本基金变更为混合基金，并相应修改本基金的《基金合同》。

本基金投资范围为香港证券市场公开上市的股票、固定收益产品、基金、货币市场工具以及相关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出具有持续竞争优势，且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。本基金的业绩比较基准为：MSCI 中华指数（MSCI ZhongHua Index）。

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、会计估计和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

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。

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

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

6.4.6.1 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 06 月 30 日
活期存款	42,031,569.56
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：	42,031,569.56

注：本基金于 2018 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：港币 31,285,057.59 元（折合人民币 26,376,432.06 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 06 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	174,514,415.54	177,953,791.48	3,439,375.94
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	174,514,415.54	177,953,791.48	3,439,375.94

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06月30日
应收活期存款利息	2,712.35
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	584.74
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	-
应收黄金合约拆借利息	-
其他	-
合计	3,297.09

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06月30日
交易所市场应付交易费用	114,978.37
银行间市场应付交易费用	-
合计	114,978.37

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,633.16
应付审计费	29,752.78
应付信息披露费	168,765.71
合计	201,151.65

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	250,064,012.27	250,064,012.27
本期申购	62,144,206.67	62,144,206.67
本期赎回（以“-”号填列）	-112,969,600.20	-112,969,600.20
-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	199,238,618.74	199,238,618.74

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	35,500,809.27	-667,904.50	34,832,904.77
本期利润	24,517,603.61	-29,703,556.09	-5,185,952.48
本期基金份额交易产生的变动数	-11,518,419.90	6,695,378.50	-4,823,041.40
其中：基金申购款	13,228,921.18	-974,702.40	12,254,218.78
基金赎回款	-24,747,341.08	7,670,080.90	-17,077,260.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,499,992.98	-23,676,082.09	24,823,910.89

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
活期存款利息收入	82,715.96
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	9,884.94
其他	819.08

合计	93,419.98
----	-----------

注:表中“其他”为直销申购款利息收入和保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
卖出股票成交总额	334,990,890.22
减:卖出股票成本总额	310,705,436.12
买卖股票差价收入	24,285,454.10

6.4.7.13 基金投资收益

注:本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

注:本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注:本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

注:本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,903,157.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,903,157.74

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	-29,703,556.09
——股票投资	-29,703,556.09
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-29,703,556.09

6.4.7.19 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
基金赎回费收入	135,537.86
其他	-
合计	135,537.86

6.4.7.20 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
交易所市场交易费用	1,116,516.37
银行间市场交易费用	-
合计	1,116,516.37

6.4.7.21 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
港股通证券组合费	6,312.81
银行汇划费用	82.00
合计	184,913.30

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brother Harriman & Co.）（“布朗兄弟”）	基金境外托管人

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

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股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,321,018.54	1,753,296.60
其中：支付销售机构的客户维护费	130,082.27	66,332.86

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.60%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.60\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	435,191.02	328,743.18

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日
期初持有的基金份额	40,017,937.50	40,017,937.50
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	40,017,937.50	40,017,937.50
期末持有的基金份额占基金总份额比例 (%)	20.09	18.61

注：本公司分别于 2010 年 5 月 25 日, 2010 年 6 月 23 日运用固有资金 25,000,000.00 元，

15,000,000.00 元认购本基金，总计认购本基金份额 40,017,937.50 份（含募集期利息结转的份额），认购费用 2,000.00 元，符合招募说明书规定的认购费率。

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01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	15,568,233.98	82,715.96	10,526,312.24	101,025.88
布朗兄弟哈里曼银行	26,463,335.58	-	22,289,400.46	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按适用利率计息。

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直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末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的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截止 2018 年 6 月 30 日，本基金合计持有中国森林（00930.HK）624,000 股。于 2017 年 2 月 22 日，中国森林（00930.HK）发布公告，香港联合交易所有限公司宣布，自 2017 年 2 月 24 日上午 9 时起，该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。为维护基金持有人利益，根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》的规定，依据中国森林控股有限公司公开披露的信息，汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人协商一致，将汇添富香港优势精选混合型证券投资基金持有中国森林（00930.HK）按每股 0.00 港元估值。

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证券款余额。

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证券款余额。

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。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。此外，基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

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，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。

本基金所持证券均在证券交易所上市；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，本报告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及部分应收申购款。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 06 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	42,031,569.56	-	-	-	-	-	42,031,569.56
备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-

交易性金融资产	-	-	-	-	-	-177,953,791.48	177,953,791.48
应收股利	-	-	-	-	-	925,032.09	925,032.09
应收利息	-	-	-	-	-	3,297.09	3,297.09
应收申购款	128,410.72	-	-	-	-	163,537.87	291,948.59
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,380,197.60	4,380,197.60
应收买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	42,159,980.28	-	-	-	-	-183,425,856.13	225,585,836.41
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	846,957.54	846,957.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	303,329.50	303,329.50
应付托管费	-	-	-	-	-	56,874.29	56,874.29
应付证券清算款	-	-	-	-	-	15.43	15.43
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	114,978.37	114,978.37
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	201,151.65	201,151.65
负债总计	-	-	-	-	-	1,523,306.78	1,523,306.78
利率敏感度缺口	42,159,980.28	-	-	-	-	-181,902,549.35	224,062,529.63
上年度末 2017年	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

12月31日							
资产							
银行存款	22,386,169.29	-	-	-	-	-	22,386,169.29
备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-262,908,574.20	262,908,574.20
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	5,438.28	5,438.28
应收申购款	245,068.55	-	-	-	-	330,180.84	575,249.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	22,631,237.84	-	-	-	-	-263,244,193.32	285,875,431.16
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	248,423.60	248,423.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	376,421.96	376,421.96
应付托管费	-	-	-	-	-	70,579.11	70,579.11
应付证券清算款	-	-	-	-	-	37.27	37.27
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	132,132.84	132,132.84
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	150,919.34	150,919.34
负债总计	-	-	-	-	-	978,514.12	978,514.12
利率敏感度缺	22,631,237.84	-	-	-	-	-262,265,679.20	284,896,917.04

口							
---	--	--	--	--	--	--	--

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约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：本基金本报告期末及上年度末计息资产仅包括银行存款及部份应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

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06月30日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	26,376,432.06	-	26,376,432.06
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	177,953,791.48	-	177,953,791.48
应收股利	74,105.92	850,926.17	-	925,032.09
应收利息	-	0.08	-	0.08
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	4,380,197.60	-	4,380,197.60
其它资产	-	-	-	-
资产合计	74,105.92	209,561,347.39	-	209,635,453.31
以外币计价的负债				

应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	74,105.92	209,561,347.39	-	209,635,453.31
项目	上年度末 2017年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	1,861,996.56	-	1,861,996.56
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	262,908,574.20	-	262,908,574.20
应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	0.33	-	0.33
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	264,770,571.09	-	264,770,571.09
以外币计价的负债				

应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	264,770,571.09	-	264,770,571.09

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	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。		
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06月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	港币相对人民币升值5%	9,159,245.77	13,238,528.55
	港币相对人民币贬值5%	-9,159,245.77	-13,238,528.55
	美元相对人民币升值5%	3,705.30	-
	美元相对人民币贬值5%	-3,705.30	-

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的股票，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06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	177,953,791.48	79.42	262,908,574.20	92.28
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	177,953,791.48	79.42	262,908,574.20	92.28

注：本基金投资于股票的基金资产占基金资产总值的比例为60%-95%；其余基金资产投资于固定收益产品、基金、货币市场工具以及相关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具，其占基金资产总值的比例为5%-40%，其中基金持有的现金和到期日在一年以内的政府债券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上。

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，即与基金投资组合的贝塔系数紧密相关； 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06月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	MSCI 中华指数上涨5%	10,503,538.61	13,237,681.24
	MSCI 中华指	-10,503,538.61	-13,237,681.24

	数下跌 5%		
--	--------	--	--

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	177,953,791.48	78.89
	其中：普通股	177,953,791.48	78.89
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	42,031,569.56	18.63
8	其他各项资产	5,600,475.37	2.48
9	合计	225,585,836.41	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 72,580,202.63 元，占期末净值比例 32.39%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
香港	177,953,791.48	79.42
合计	177,953,791.48	79.42

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
10 能源	10,638,235.80	4.75
15 原材料	-	-
20 工业	11,213,651.55	5.00
25 非必需消费品	14,388,344.60	6.42
30 必需消费品	17,237,179.50	7.69
35 医疗保健	15,809,389.65	7.06
40 金融	33,012,423.60	14.73
45 信息技术	61,532,641.78	27.46
50 电信服务	9,914,856.00	4.43
55 公用事业	-	-
60 房地产	4,207,069.00	1.88
合计	177,953,791.48	79.42

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证券 市场	所属国 家(地 区)	数量(股)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有 限公司	700 HK	香港联合 交易所	香港	66,000.0 0	21,912,8 43.48	9.78
2	AAC Technologies Inc.	瑞声科技控 股有限公司	2018 HK	香港联合 交易所	香港	140,000. 00	13,042,7 57.00	5.82
3	Dali Food Group Company Limited	达利食品集 团有限公司	3799 HK	香港联合 交易所	香港	2,500,00 0.00	12,751,8 87.50	5.69
4	Chinasoft International Ltd	中软国际有 限公司	354 HK	香港联合 交易所	香港	2,450,00 0.00	12,641,4 41.40	5.64
5	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港 (控股)有限 公司	2388 HK	香港联合 交易所	香港	360,000. 00	11,214,9 16.20	5.01
6	China Petroleum & Chemical	中国石化 工股份有限 公司	386 HK	香港联合 交易所	香港	1,800,00 0.00	10,638,2 35.80	4.75

	Corporation							
7	China Unicom (Hong Kong) Limited.	中国联合网络通信(香港)股份有限公司	762 HK	香港联合交易所	香港	1,200,000.00	9,914,856.00	4.43
8	Shanghai Fosun Pharmaceutical (Group) Co., Ltd.	上海复星医药(集团)股份有限公司	2196 HK	香港联合交易所	香港	270,000.00	9,799,772.85	4.37
9	China Maple Leaf Educational Systems Limited	中国枫叶教育集团有限公司	1317 HK	香港联合交易所	香港	800,000.00	9,537,147.20	4.26
10	China Literature Limited	阅文集团	772 HK	香港联合交易所	香港	150,000.00	9,320,470.50	4.16
11	Agricultural Bank of China Limited	中国农业银行股份有限公司	1288 HK	香港联合交易所	香港	2,800,000.00	8,663,695.60	3.87
12	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港联合交易所	香港	1,400,000.00	8,557,465.00	3.82
13	3SBio Inc.	三生制药	1530 HK	香港联合交易所	香港	400,000.00	6,009,616.80	2.68
14	Air China Limited	中国国际航空股份有限公司	753 HK	香港联合交易所	香港	900,000.00	5,751,628.20	2.57
15	China Southern Airlines Company Limited	中国南方航空股份有限公司	1055 HK	香港联合交易所	香港	1,050,000.00	5,462,023.35	2.44
16	XinYi Glass Holdings Limited	信义玻璃控股有限公司	868 HK	香港联合交易所	香港	600,000.00	4,851,197.40	2.17
17	Kingsoft Corporation Limited	金山软件有限公司	3888 HK	香港联合交易所	香港	230,000.00	4,615,129.40	2.06

18	Hong Kong Exchange and Clearing Ltd.	香港交易及结算有限公司	388 HK	香港联合交易所	香港	23,000.00	4,576,346.80	2.04
19	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	中国蒙牛乳业有限公司	2319 HK	香港联合交易所	香港	200,000.00	4,485,292.00	2.00
20	CIFI Holdings (Group) Co. Ltd.	旭辉控股(集团)有限公司	884 HK	香港联合交易所	香港	1,000,000.00	4,207,069.00	1.88
21	China Forestry Holdings Co., Limited	中国森林控股有限公司	930 HK	香港联合交易所	香港	624,000.00	-	-

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	16,622,636.39	5.83
2	Tencent Holdings Ltd	700 HK	16,477,228.58	5.78
3	Kingsoft Corporation Limited	3888 HK	13,642,992.48	4.79
4	Dali Foods Group Company Limited	3799 HK	13,032,726.14	4.57
5	Shenzhen Investment Limited	604 HK	12,074,067.69	4.24
6	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	2388 HK	11,625,508.57	4.08
7	China Unicom (Hong Kong) Ltd.	762 HK	11,083,787.35	3.89
8	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	10,897,039.82	3.82
9	Shanghai Fosun	2196 HK	10,611,345.88	3.72

	Pharmaceutical (Group) Co., Ltd			
10	Imax China Holding, Inc.	1970 HK	10,332,009.32	3.63
11	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	9,864,689.54	3.46
12	Country Garden Holdings Co. Ltd	2007 HK	9,719,133.64	3.41
13	China Literature Limited	772 HK	9,704,706.83	3.41
14	CK Infrastructure Holdings Limited	1038 HK	9,518,020.45	3.34
15	China Resources Land Limited	1109 HK	9,236,728.48	3.24
16	China Vanke Co., Ltd.	2202 HK	9,178,810.11	3.22
17	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	8,032,434.12	2.82
18	AAC Technologies Holdings Inc.	2018 HK	7,746,013.44	2.72
19	Air China Limited	753 HK	6,989,829.06	2.45
20	China Southern Airlines Company Limited	1055 HK	6,947,490.02	2.44
21	Chongqing Rural Commercial Bank Co., Ltd.	3618 HK	6,491,265.60	2.28
22	China Jinmao Holdings Group Limited	817 HK	5,998,197.49	2.11

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Ping An Insura	2318 HK	27,043,678.06	9.49

	nce (Group) Comp any of China, L td.			
2	Tencent Holdings Ltd	700 HK	21,671,113.85	7.61
3	China Shenhua En ergy Company L imited	1088 HK	15,646,579.48	5.49
4	Hong Kong Exchan ges and Cleari ng Ltd.	388 HK	14,763,889.05	5.18
5	CIFI Holdings (G roup) Co. Ltd.	884 HK	14,253,339.04	5.00
6	HSBC Holdings Pl c	5 HK	14,241,186.12	5.00
7	CSPC Pharmaceutic al Group Limit ed	1093 HK	14,172,477.64	4.97
8	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	13,853,327.95	4.86
9	Brilliance China Automotive Ho ldings Ltd.	1114 HK	13,734,516.81	4.82
10	Chongqing Rural Commercial Bank Co.,Ltd.	3618 HK	13,141,336.93	4.61
11	China Everbright International Ltd.	257 HK	11,869,983.20	4.17
12	Imax China Holdi ng, Inc.	1970 HK	11,764,014.47	4.13
13	3SBio Inc.	1530 HK	11,257,886.28	3.95
14	Shenzhen Investme nt Limited	604 HK	10,768,161.19	3.78
15	China Resources Land Limited	1109 HK	10,044,779.06	3.53
16	Guangzhou Automob ile Group Co., Ltd.	2238 HK	10,032,897.23	3.52
17	Sino Biopharmac eutical Limited	1177 HK	9,744,384.26	3.42
18	China Constructio n Bank Corpora	939 HK	9,196,767.42	3.23

	tion			
19	Xinyi Solar Holdings Limited	968 HK	9,096,997.41	3.19
20	China Vanke Co., Ltd.	2202 HK	8,921,821.00	3.13
21	Agricultural Bank of China Limited	1288 HK	8,830,010.44	3.10
22	CK Infrastructure Holdings Limited	1038 HK	8,320,256.95	2.92
23	Kingsoft Corporation Limited	3888 HK	8,135,042.48	2.86
24	Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited	1458 HK	7,978,383.68	2.80
25	Country Garden Holdings Co. Ltd	2007 HK	7,913,658.62	2.78
26	China Jinmao Holdings Group Limited	817 HK	7,086,196.79	2.49
27	Huatai Securities Co., Ltd.	6886 HK	6,145,623.14	2.16

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	255,454,209.49
卖出收入（成交）总额	334,990,890.22

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	4,380,197.60
3	应收股利	925,032.09
4	应收利息	3,297.09
5	应收申购款	291,948.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,600,475.37

7.11.4 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。

7.11.5 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 (%)

4,884	40,794.15	136,155,068.59	68.34	63,083,550.15	31.66
-------	-----------	----------------	-------	---------------	-------

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	97,084.10	0.05

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
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(2010年6月25日)基金份额总额	522,636,079.14
本报告期期初基金份额总额	250,064,012.27
本报告期基金总申购份额	62,144,206.67
减：本报告期基金总赎回份额	112,969,600.20
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	199,238,618.74

注：总申购份额含红利再投份额。

§ 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钱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钱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。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

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 (%)	
招商证券	2	394,979,116.98	66.90	371,995.93	84.50	-
Goldman Sachs Group, Inc.	-	72,027,442.26	12.20	21,608.24	4.91	-
Sanford C. Bernstein & Co.	-	71,778,341.45	12.16	21,533.51	4.89	-
Credit Suisse	-	29,109,058.91	4.93	8,732.71	1.98	-
CCB International Securities Ltd	-	13,692,519.36	2.32	13,692.52	3.11	-
China International Capital Corporation	-	8,858,620.75	1.50	2,657.58	0.60	-
BNP Paribas	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Group Limited	-	-	-	-	-	-
BOC International Holdings Ltd	-	-	-	-	-	-
China Merchant Security	-	-	-	-	-	-
ICBC INTERNATIONAL	-	-	-	-	-	-

L						
---	--	--	--	--	--	--

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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Group, Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein & Co.	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Group Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
BOC	-	-	-	-	-	-	-	-

International Holdings Ltd								
China Merchant Security	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC INTERNATIONAL	-	-	-	-	-	-	-	-

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:

本基金本报告期末新增或退租交易单元。

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 QDII 基金 2017 年年度资产	公司网站	2018-01-03

	净值的公告		
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加农业银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-01-12
3	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	2018-01-19
4	汇添富基金管理有限公司旗下公募基金 2017 年第 4 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-01-22
5	汇添富香港优势精选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	2018-03-03
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中信银行为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-03-12
7	关于汇添富基金管理股份有限公司旗下 93 只基金修订基金合同的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 公司网站, 深交所	2018-03-24
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下 93 只基金 2017 年年度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-03-28
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加工商银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-03-30
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-03-30
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	2018-03-31
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加电盈基金为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-04-09
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加南洋商业银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-04-19
14	汇添富基金旗下 99 只基金 2018 年第 1 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-04-21
15	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	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-04-23

	展的费率优惠活动的公告		
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-06-22
17	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	2018-06-30
18	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2018 半年资产净值的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-06-30

§ 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 19 日至 2018 年 6 月 30 日	40,017,937.50	-	-	40,017,937.50	20.09
	2	2018 年 5 月 23 日至 2018 年 6 月 30 日	44,196,516.06	-	-	44,196,516.06	22.18
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亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选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、《关于汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；

6、《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金基金合同》；

7、《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金托管协议》；

8、报告期内汇添富香港优势精选混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；

9、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 08 月 25 日