

---

# 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）2018 年年度报告摘 要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 月 26 日

## 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 5 月 23 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                      |                      |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 基金简称            | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）  |                      |
| 基金主代码           | 501057               |                      |
| 基金运作方式          | 上市契约型开放式（LOF）        |                      |
| 基金合同生效日         | 2018 年 5 月 23 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      | 333,619,427.25 份     |                      |
| 基金合同存续期         | 不定期                  |                      |
| 基金份额上市的证券交易所    | 上海证券交易所              |                      |
| 上市日期            | 2018 年 6 月 20 日      |                      |
| 下属分级基金的基金简称     | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C |
| 下属分级基金的场内简称     | 新能源车                 | 新能车 C                |
| 下属分级基金的交易代码     | 501057               | 501058               |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 192,303,723.13 份     | 141,315,704.12 份     |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。   |
| 投资策略 | 本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适 |

|        |   |
|--------|---|
|        | 当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。          |
| 业绩比较基准 | 中证新能源汽车产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%                                 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |

### 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<br>负责人 | 姓名   | 李鹏                 | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-28932888       | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | service@99fund.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 400-888-9918       | 95588               |
| 传真          |      | 021-28932998       | 010-66105798        |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                                      |
|---------------------|--------------------------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.99fund.com                       |
| 基金年度报告备置地点          | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司 |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数<br>据和指标 | 2018 年 05 月 23 日（基金合同生效日）-2018 年 12 月 31 日 |                           |
|-------------------|--|---------------------------|
|                   | 汇添富中证新能源汽车产业指数<br>(LOF) A                  | 汇添富中证新能源汽车产业指数<br>(LOF) C |
| 本期已实现收益           | -6,999,866.10                              | -5,185,499.03             |
| 本期利润              | -53,242,257.96                             | -41,140,871.03            |
| 加权平均基金份额本期利润      | -0.2297                                    | -0.1990                   |
| 本期基金份额净值增长率       | -23.19%                                    | -23.40%                   |

| 3.1.2 期末数<br>据和指标 | 2018 年末        |                |
|-------------------|----------------|----------------|
| 期末可供分配<br>基金份额利润  | -0.2319        | -0.2340        |
| 期末基金资产<br>净值      | 147,698,881.82 | 108,251,262.15 |
| 期末基金份额<br>净值      | 0.7681         | 0.7660         |

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。

4、本基金的《基金合同》生效日为 2018 年 5 月 23 日，至本报告期末未满一年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2018 年 12 月 31 日数据，特此说明。

### 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

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A

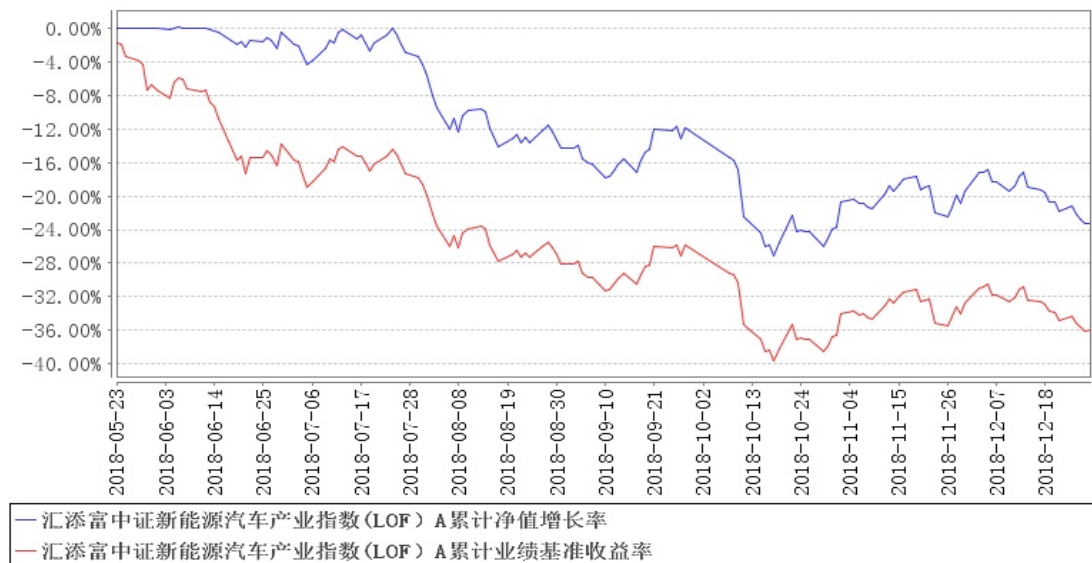
| 阶段    | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④    |
|-------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -12.90%      | 1.81%               | -13.70%            | 1.92%                     | 0.80%  | -0.11% |
| 过去六个月 | -22.89%      | 1.54%               | -25.85%            | 1.68%                     | 2.96%  | -0.14% |
| 自基金合同 | -23.19%      | 1.41%               | -36.04%            | 1.68%                     | 12.85% | -0.27% |

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C

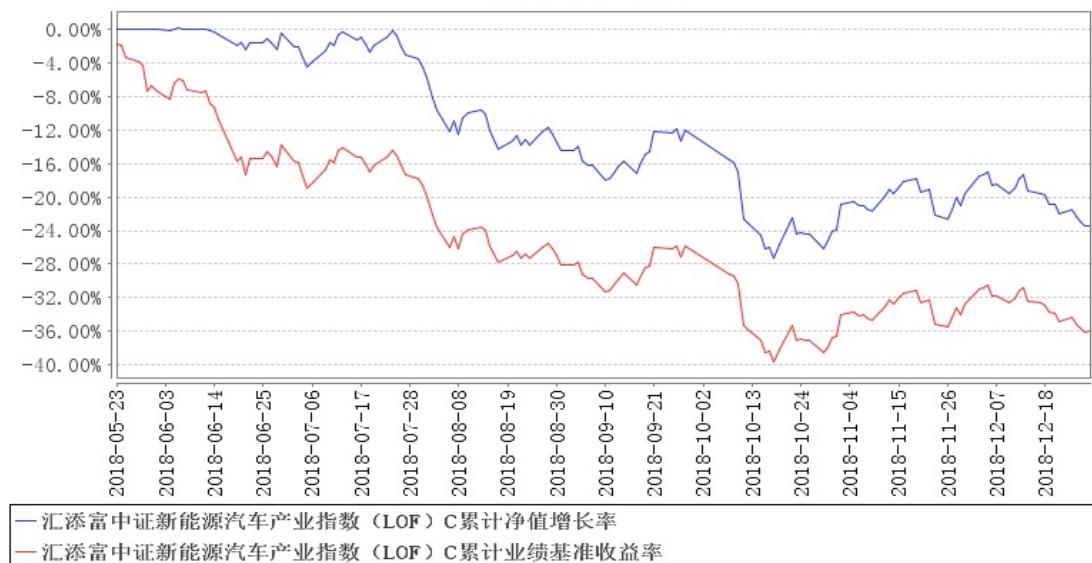
| 阶段    | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④    |
|-------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -12.97%      | 1.81%               | -13.70%            | 1.92%                     | 0.73%  | -0.11% |
| 过去六个月 | -23.04%      | 1.54%               | -25.85%            | 1.68%                     | 2.81%  | -0.14% |
| 自基金合同 | -23.40%      | 1.41%               | -36.04%            | 1.68%                     | 12.64% | -0.27% |

### 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

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A 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



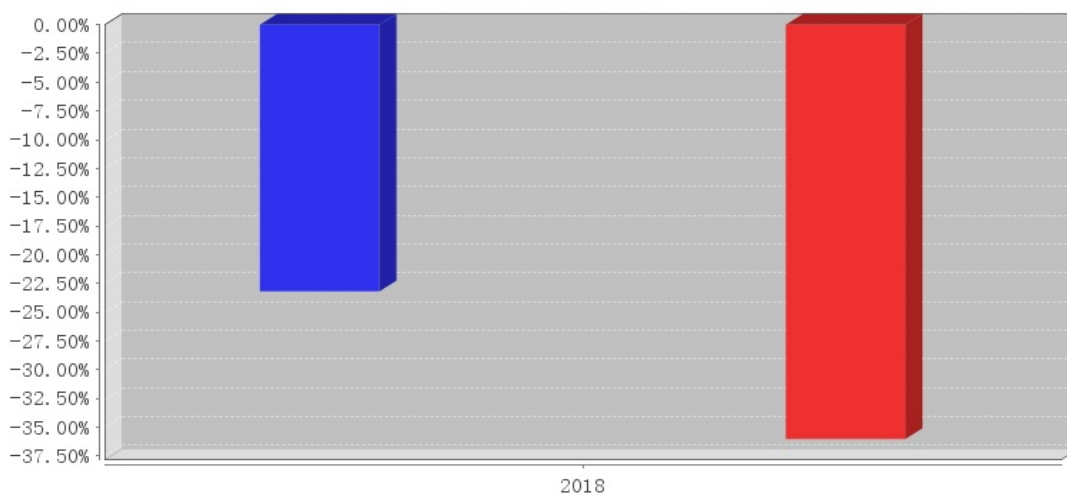
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2018 年 5 月 23 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（2018 年 5 月 23 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。

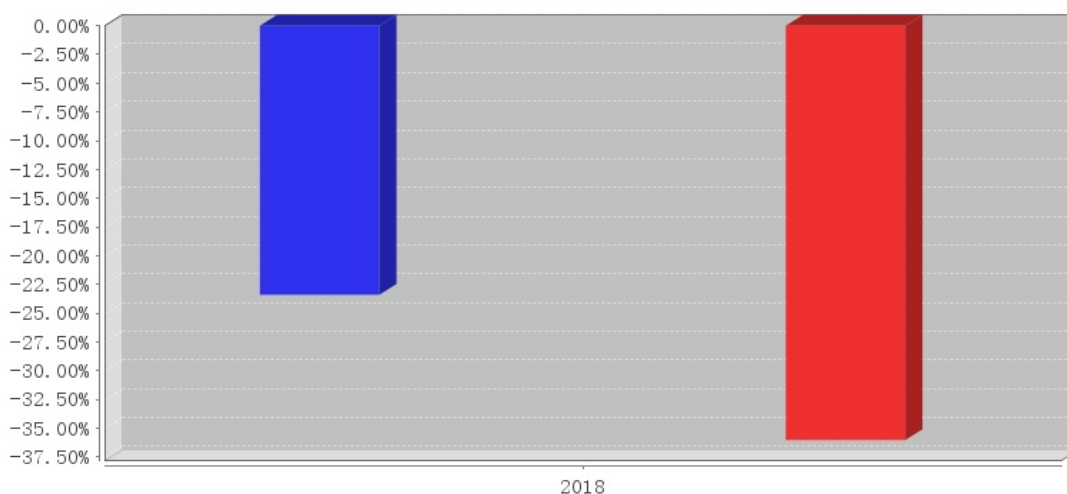
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



■ 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A净值收益率  
■ 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A业绩基准收益率

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



■ 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C净值收益率  
■ 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C业绩基准收益率

注：1、本基金的《基金合同》生效日为2018年5月23日，至本报告期末未满一年。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：元

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A

| 年度    | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|-------|-------------|----------|-----------|----------|----|
| 2018年 | 0.0000      | 0.00     | 0.00      | 0.00     | -  |
| 2017年 | 0.0000      | 0.00     | 0.00      | 0.00     | -  |

|        |        |      |      |      |   |
|--------|--------|------|------|------|---|
| 2016 年 | 0.0000 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |
| 合计     | 0.0000 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |   |

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C

| 年度     | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|--------|---------------|----------|-----------|----------|----|
| 2018 年 | 0.0000        | 0.00     | 0.00      | 0.00     | -  |
| 2017 年 | 0.0000        | 0.00     | 0.00      | 0.00     | -  |
| 2016 年 | 0.0000        | 0.00     | 0.00      | 0.00     | -  |
| 合计     | 0.0000        | 0.00     | 0.00      | 0.00     |    |

注：本基金成立于 2018 年 5 月 23 日，2018 年度未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

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

2018 年，汇添富基金新成立 23 只公募基金，包括 13 只混合型基金，2 只股票型基金，2 只指数基金，6 只债券基金。新发重点主动权益产品包括添富价值创造定开混合、添富行业整合混合、



添富智能制造股票、汇添富文体娱乐混合、添富创新医药混合、添富全球消费混合（QDII）等，有序推动不同久期、信用级别的债券产品落地，参与发售战略配售基金，探索养老目标日期 FOF 基金。2018 年底，公司公募基金产品总数达 120 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2018 年，汇添富基金进一步夯实自有平台基础建设，在全方位升级平台架构及安全系统的基础上，不断引领行业创新，规模及客户数均处于行业领先水平。全年实现指纹识别、人脸识别、常用设备保护、7\*24 小时智能交易监控等重大升级；推出多款树立行业标杆的拳头功能：指数宝、理财日历、模拟组合、实时估值等。与此同时，互联网金融对外合作业务取得重大突破，与多家互联网巨头达成深度战略合作。截至年底，对外合作伙伴数量已超 110 家，成为业内对外合作最多的公司之一。

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

2018 年，公司积极开展渠道销售和培训工作，专业的投顾服务以及良好的渠道维护口碑不断提升汇添富品牌在渠道影响力和认可度。同时公司持续大力开展定投、投资者教育、添富论坛等系列客户活动，营销培训活动拓展到银行和券商的网点、营业部。

2018 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，全方位优化客户服务体系。公司通过完善大客户平台建设，搭建了囊括投顾式服务、基金理财、高端客户、现金宝的全新客服体系，为公司各项销售业务提供全方位支持。同时，持续优化电话、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提高客服体验。

2018 年，香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理继续发挥显著成效，国际业务总资产管理规模取得长足进步。公司海外产品线进一步完善，发行了 QDII 项下汇添富全球消费行业混合型证券投资基金；港股通项下添富沪港深大盘价值混合基金、添富沪港深优势定开基金。

“港股通”类委外专户管理规模继续保持领先，海外主动管理权益资产规模保持行业前列。2018 年，香港子公司在加强母公司投研一体化基础上，港股投资及海外债券投资业绩持续优异，汇添富中港策略基金获得晨星三年与五年的五星评级，根据彭博统计在最近三年、五年同类港股基金中业绩均位列第一；汇添富港币债券基金获得晨星三年和五年四星评级。

2018 年，汇添富公益事业坚持不懈，连续第十一年开展“河流·孩子”公益助学计划。继

2017 年公司党委下属的八个党支部和各地“添富小学”建立结对关系后，2018 年，各支部纷纷前往相应学校开展回访及支教活动。党员们经过实地探访，了解学校实际困难和发展需求，邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的“添富小学”参加公益服务，并通过向公司员工发售筹款台历、参加“99 公益日”筹款、参与“一个鸡蛋的暴走”等活动，全年筹款约 8 万余元，用于添富小学国学课程筹备及开设、教师培训项目开展、图书室扩充等。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务  | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|---|-----------------|------|--------|---|
|     |   | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 过蓓蓓 | 汇添富中证主要消费 ETF、汇添富中证医药卫生 ETF、汇添富中证能源 ETF、汇添富中证金融地产 ETF、汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 联接基金、汇添富主要消费 ETF 联接基金、汇添富中证生物科技指数（LOF）基金、汇添富中证中药指数（LOF）基 | 2018 年 5 月 23 日 | -    | 7      | 国籍：中国，学历：中国科学技术大学金融工程博士研究生，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理，2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费 ETF 基金、中证医药卫生 ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金、汇添富中证主要消费 ETF 联接基金的基金经理，2015 年 8 月 18 日至今任汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 基金联接基 |

|  |   |  |  |  |
|--|---|--|--|--|
|  | 金、汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）基金、中证银行 ETF 基金的基金经理。 |  |  | 金的基金经理，2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技指数（LOF）基金的基金经理，2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证中药指数（LOF）基金的基金经理，2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）基金的基金经理，2018 年 10 月 23 日至今任中证银行 ETF 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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究环节，公司建立了统一的投

研平台信息管理系统，公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时，通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。（2）在投资环节，公司针对基金、专户、社保、境外投资分别设立了投资决策委员会，各委员会根据各自议事规则分别召开会议，在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略，独立制定资产配置计划和组合调整方案，并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。（3）在交易环节，公司实行集中交易，所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式，按照“时间优先、价格优先、比例分配”的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理，严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配，确保交易的公平性。（4）在交易监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析方面，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。同时，投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。报告期内，本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度，进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、清算，以及稽核监察等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3日、5日）同向交易的样本，根据95%置信区间下差价率的T检验显著程度、差价率均值是否小于1%、同向交易占优比等方面进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与

的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的交易次数为 13 次，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年全球主要股票指数均出现不同程度的下跌，A 股跌幅居前，全年沪深 300 指数下跌 25.31%，创业板指下跌 28.65%，恒生指数下跌 13.61%。一季度开始，市场风格出现了较大变化，2017 年强势板块明显回调，中美贸易摩擦自 3 月下旬开始影响全球市场的风险偏好及波动性，成为 2018 全年对市场影响最为深远的外部事件。整个上半年，贸易战的阴影叠加金融去杠杆、挤泡沫的不放松，实体融资利率快速上行，经济下行压力陡升。疫苗事件的爆发使得上半年难得正收益的板块医药生物板块快速大幅下跌，再次带动风险偏好急降，市场出现大幅单边下跌。至 7 月，内部政策出现变化信号。国务院常务会议和政治局会议后，紧信用状态边际缓和；理财新规正式稿发布，金融监管长期方向不动摇，短期适度放好于预期；促消费、降税费改革政策细则落地，市场迎来短暂的回暖。至四季度，中美贸易摩擦再度陷入僵局，美股也出现大幅调整，全球市场连锁反应，引发对全球经济增长的担忧。为稳定国内市场预期，监管频繁发声要在完善市场基本制度、鼓励长期资金入市、促进国企改革和民企发展、扩大开放等几个方面着手落实。同时，理财新规、理财子公司业务规范继资管新规后陆续落地。12 月，中央政治局会议、中央经济工作会议召开，提出了 2019 年经济工作“稳”字为主的基调，强调“宏观政策要强化逆周期调节”，首提“改善货币政策传导机制”，修复民企融资，金融监管及货币政策边际宽松明显。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位报告期内基本保持在 90%~95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A 基金份额净值为 0.7681 元，本报告期基金份额净值增长率为-23.19%；截至本报告期末汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C 基金份额净值为 0.7660 元，本报告期基金份额净值增长率为-23.40%；同期业绩比较基准收益率为-36.04%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年，市场仍然面临成长股商誉减值风险、中美贸易对经济的全面影响等不确定性因素，但内部政策正不断出台和优化。针对中小微企业、民企的“TMLF”重点支持，股权质押纾困基金落地；发改委项目批复加快、房地产边际放松；资本市场严查违规减持、业绩造假；银行理财子

公司首批正式批复。政府、企业、监管、市场多个维度正在发生变化。A 股在 2018 年率先全球进行了充分的调整，优质龙头企业在下行期仍然保持稳定的业绩增长，而估值已当属“便宜”。而美股高位调整的趋势逐渐明晰，美联储加息次数在 2019 年或将低于预期，全球资产配置资金正是看到了资产相对价值的变化，正加速流入 A 股。

汽车行业在 2018 年遭遇了社会消费增速下滑带来的销售减少、库存增加，但新能源汽车是汽车板块中销售最好的板块，同比、环比均保持高增长，但由于补贴调整后市场化竞争对于产业链利润的压制较大，产业链优胜劣汰仍在进行中。中期来看，产业链通过价格竞争、技术进步、利润压缩将过剩落后产能出清利于产业链健康发展。2019 年是新能源汽车补贴结束的倒数第二年，补贴退坡幅度有可能超过市场预期。因此，中游的充分出清有利于补贴退坡后下游成本转移和整个产业链压力的释放。新能源汽车产业指数也根据产业发展状况剔除了主业不清晰、盲目扩产能、规模不经济的上市公司。

作为被动投资的指数型基金，汇添富中证新能源汽车产业指数基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的指数化投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司以维护基金份额持有人利益为宗旨，有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则，认真履行职责，通过合规法务、投资风控、稽核内审工作，加强公司经营与基金运作的合规性监察，促进内部控制和风险管理的不断改进，并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

##### 1、进一步提升合规法务管理工作

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

##### 2、进一步完善投资风险控制工作

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

##### 3、进一步加强稽核内审工作

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

善内部控制管理。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强合规管理和风险控制，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

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

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，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。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）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，汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的托管人——汇添富基金管理股份有限公司在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）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。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）2018 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师徐艳、许培菁于 2019 年 3 月 25 日签字出具了安永华明（2019）审字第 60466941\_B110 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。



## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：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）

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产                      | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|--------------------------|---------------------------------|
| <b>资 产：</b>              |                                 |
| 银行存款                     | 22,158,817.40                   |
| 结算备付金                    | -                               |
| 存出保证金                    | 92,489.73                       |
| 交易性金融资产                  | 234,314,242.31                  |
| 其中：股票投资                  | 234,256,404.53                  |
| 基金投资                     | -                               |
| 债券投资                     | 57,837.78                       |
| 资产支持<br>证券投资             | -                               |
| 贵金属投<br>资                | -                               |
| 衍生金融资产                   | -                               |
| 买入返售金融资<br>产             | -                               |
| 应收证券清算款                  | -                               |
| 应收利息                     | 4,550.42                        |
| 应收股利                     | -                               |
| 应收申购款                    | 65,206.79                       |
| 递延所得税资产                  | -                               |
| 其他资产                     | -                               |
| 资产总计                     | 256,635,306.65                  |
| <b>负债和所有者权<br/>    益</b> | <b>本期末<br/>2018 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                   | -                               |
| 卖出回购金融资<br>产款            | -                               |
| 应付证券清算款                  | -                               |
| 应付赎回款                    | 103,615.63                      |
| 应付管理人报酬                  | 228,581.69                      |
| 应付托管费                    | 22,858.17                       |

|               |                |
|---------------|----------------|
| 应付销售服务费       | 24,300.36      |
| 应付交易费用        | 1,847.07       |
| 应交税费          | 1.00           |
| 应付利息          | -              |
| 应付利润          | -              |
| 递延所得税负债       | -              |
| 其他负债          | 303,958.76     |
| 负债合计          | 685,162.68     |
| <b>所有者权益：</b> |                |
| 实收基金          | 333,619,427.25 |
| 未分配利润         | -77,669,283.28 |
| 所有者权益合计       | 255,950,143.97 |
| 负债和所有者权益总计    | 256,635,306.65 |

注：(1) 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7672 元，基金份额总额 333,619,427.25 份，其中下属 A 类基金份额参考净值 0.7681 元，份额总额 192,303,723.13 份；下属 C 类基金份额参考净值 0.7660 元，份额总额 141,315,704.12 份。

(2) 本基金合同于 2018 年 5 月 23 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2018 年 12 月 31 日数据，特此说明。

## 7.2 利润表

会计主体：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）

本报告期：2018 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目               | 本期   |
|-------------------|--|
|                   | 2018 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日 |
| 一、收入              | -90,631,007.32                             |
| 1. 利息收入           | 2,088,870.71                               |
| 其中：存款利息收入         | 1,258,654.71                               |
| 债券利息收入            | 66.44                                      |
| 资产支持证券利息收入        | -  |
| 买入返售金融资产收入        | 830,149.56                                 |
| 其他利息收入            | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | -10,994,249.93                             |
| 其中：股票投资收益         | -14,208,095.58                             |
| 基金投资收益            | -  |

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 债券投资收益                     | 30,280.83      |
| 资产支持证券投资<br>投资收益           | -              |
| 贵金属投资收<br>益                | -              |
| 衍生工具收益                     | -              |
| 股利收益                       | 3,183,564.82   |
| 3. 公允价值变动收益<br>(损失以“-”号填列) | -82,197,763.86 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-<br>”号填列)     | -              |
| 5. 其他收入(损失以“-<br>”号填列)     | 472,135.76     |
| 减：二、费用                     | 3,752,121.67   |
| 1. 管理人报酬                   | 2,388,701.39   |
| 2. 托管费                     | 238,870.13     |
| 3. 销售服务费                   | 284,244.91     |
| 4. 交易费用                    | 501,747.04     |
| 5. 利息支出                    | -              |
| 其中：卖出回购金融<br>资产支出          | -              |
| 6. 税金及附加                   | 0.24           |
| 7. 其他费用                    | 338,557.96     |
| 三、利润总额(亏损总<br>额以“-”号填列)    | -94,383,128.99 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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）

本报告期：2018 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                   | 本期<br>2018 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日 |                |                 |
|--------------------------------------|--|----------------|-----------------|
|                                      | 实收基金   | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者<br>权益（基金净值）                  | 742,196,052.24                                   | -              | 742,196,052.24  |
| 二、本期经营活<br>动产生的基金净<br>值变动数（本期<br>利润） | -  | -94,383,128.99 | -94,383,128.99  |
| 三、本期基金份<br>额交易产生的基<br>金净值变动数         | -408,576,624.99                                  | 16,713,845.71  | -391,862,779.28 |

|  |                 |                |                 |
|--|-----------------|----------------|-----------------|
| （净值减少以“-”号填列）                          |                 |                |                 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 11,543,918.95   | -1,460,773.19  | 10,083,145.76   |
| 2. 基金赎回款                               | -420,120,543.94 | 18,174,618.90  | -401,945,925.04 |
| 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）                        | 333,619,427.25  | -77,669,283.28 | 255,950,143.97  |

注：本基金合同于 2018 年 5 月 23 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益（基金净值）变动表只列示 2018 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日数据，特此说明。

本报告 7.1 至 7.4 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    |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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）（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]2076 号文《关于准予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）注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司作为基金发起人于 2018 年 5 月 7 日至 2018 年 5 月 18 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(2018)验字第 60466941\_B26 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 2018 年 5 月 23 日生效。本基金为上市契约型开放式（LOF），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 742,028,722.81 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 167,329.43 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 742,196,052.24 元，折合 742,196,052.24 份基金份额。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于其他股票（包括中小板、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、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、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、可转换债券（分离交易可转债）、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款等）、货币市场工具、金融衍生工具（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）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的相关规定）。本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金业绩比较基准为：

中证新能源汽车产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2018年12月31日的财务状况以及2018年5月23日（基金合同生效日）至2018年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2018 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和债券投资等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票和债券，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公

允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权

平均法于成交日结转；

#### (5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量



持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

- (1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；
- (2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；
- (3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；
- (4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；
- (5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；
- (6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；
- (7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；
- (8) 股指/国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；
- (9) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；
- (10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；
- (11) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
- (12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，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。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(3) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题

的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管

理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.5 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称                | 与本基金的关系            |
|----------------------|--------------------|
| 汇添富基金管理股份有限公司        | 基金管理人、基金销售机构、基金发起人 |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 基金托管人、基金代销机构       |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”）   | 基金管理人的股东、基金代销机构    |
| 东航金控有限责任公司           | 基金管理人的股东           |

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| 上海上报资产管理有限公司        | 基金管理人的股东         |
| 上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东         |
| 汇添富资产管理（香港）有限公司     | 基金管理人的子公司        |
| 汇添富资本管理有限公司         | 基金管理人的子公司        |
| 上海汇添富公益基金会          | 与基金管理人同一批的关键管理人员 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年5月23日（基金合同生效日）至2018年<br>12月31日 |                     |
|-------|---|---------------------|
|       | 成交金额                                      | 占当期股票<br>成交总额的比例（%） |
| 东方证券  | 442,135,877.33                            | 100.00              |

###### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年5月23日（基金合同生效日）至2018年12月31日 |                     |
|-------|---------------------------------------|---------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券<br>成交总额的比例（%） |
| 东方证券  | 342,433.00                            | 100                 |

###### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年5月23日（基金合同生效日）至2018年12月31日 |                       |
|-------|---------------------------------------|-----------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券回购<br>成交总额的比例（%） |
| 东方证券  | 1,485,800,000.00                      | 100.00                |

###### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.8.1.5 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5月23日（基金合同生效日）至2018年12月31日 |                   |          |                     |
|-------|---------------------------------------|-------------------|----------|---------------------|
|       | 当期<br>佣金                              | 占当期佣金总量<br>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  | 406,276.43                            | 100               | 1,847.07 | 100                 |

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

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年5月23日（基金合同生效日）至2018年12月<br>31日 |
|-----------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,388,701.39                              |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 219,377.87                                |

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年5月23日（基金合同生效日）至2018年12月<br>31日 |
|----------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 238,870.13                                |

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

### 7.4.8.2.3 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<br>2018 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日 |                      |           |
|----------------|--|----------------------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                 |                      |           |
|                | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A                             | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C | 合计        |
| 东方证券股份有限公司     | -  | 13,877.59            | 13,877.59 |
| 中国工商银行股份有限公司   | -  | 2,900.35             | 2,900.35  |
| 汇添富基金管理股份有限公司  | -  | 5,590.40             | 5,590.40  |
| 合计             | -  | 22,368.34            | 22,368.34 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.25%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。



### 7.4.8.3 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。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                         | 本期                      | 本期                      |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
|                            | 2018年05月23日至2018年12月31日 | 2018年05月23日至2018年12月31日 |
|                            | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A    | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C    |
| 基金合同生效日（2018年5月23日）持有的基金份额 | 10,003,600.36           | -                       |
| 期初持有的基金份额                  | -                       | -                       |
| 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                  | 10,003,600.36           | -                       |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例          | 5.20%                   | -                       |

注:本公司于2018年5月11日用自有资金10,001,000.00元认购本基金份额10,003,600.36份（含募集期利息结转的份额），认购费用1,000.00元。符合招募说明书规定的认购费率。

#### 7.4.8.4.2 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。

### 7.4.8.5 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5月23日（基金合同生效日）至2018年12月31日 |            |
|              | 期末余额                            | 当期利息收入     |
| 中国工商银行股份有限公司 | 22,158,817.40                   | 323,174.59 |

### 7.4.8.6 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直接购入关联方承销的证券。

### 7.4.9 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

### 7.4.10 期末(2018 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                  |                  |        |      |        |          |           |           |    |
|----------------------|------|------------------|------------------|--------|------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日            | 可流通日             | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 601860               | 紫金银行 | 2018 年 12 月 20 日 | 2019 年 01 月 03 日 | 新股流通受限 | 3.14 | 3.14   | 15,970   | 50,145.80 | 50,145.80 | -  |

#### 7.4.10.2 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。

### 7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

### 7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.11.1 公允价值

##### 7.4.11.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 7.4.11.1.2 以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.11.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 234,264,096.51 元，属于第二层次的余额为人民币 50,145.80 元，无划分为第三层次的余额。

#### 7.4.11.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

#### 7.4.11.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.4.11.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

#### 7.4.11.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

#### 7.4.11.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 20 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资   | 234,256,404.53 | 91.28         |
|    | 其中：股票  | 234,256,404.53 | 91.28         |
| 2  | 基金投资   | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资 | 57,837.78      | 0.02          |
|    | 其中：债券  | 57,837.78      | 0.02          |
|    | 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      | 22,158,817.40  | 8.63   |
| 8 | 其他各项资产            | 162,246.94     | 0.06   |
| 9 | 合计                | 256,635,306.65 | 100.00 |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | 6,331,464.00   | 2.47         |
| C  | 制造业              | 225,771,630.52 | 88.21        |
| 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           | 2,062,480.00   | 0.81         |
| 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               | 234,165,574.52 | 91.49        |

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）   | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|-----------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -         | -            |
| B  | 采矿业              | -         | -            |
| C  | 制造业              | 40,684.21 | 0.02         |
| 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              | 50,145.80 | 0.02         |
| 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               | 90,830.01 | 0.04         |

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未有港股通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 600104 | 上汽集团 | 833,043 | 22,217,256.81 | 8.68         |
| 2  | 002594 | 比亚迪  | 365,500 | 18,640,500.00 | 7.28         |
| 3  | 300124 | 汇川技术 | 468,000 | 9,425,520.00  | 3.68         |
| 4  | 002466 | 天齐锂业 | 321,200 | 9,417,584.00  | 3.68         |

|    |        |      |           |              |      |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 5  | 002460 | 赣锋锂业 | 365,800   | 8,076,864.00 | 3.16 |
| 6  | 300750 | 宁德时代 | 102,900   | 7,594,020.00 | 2.97 |
| 7  | 600066 | 宇通客车 | 622,600   | 7,377,810.00 | 2.88 |
| 8  | 603799 | 华友钴业 | 233,280   | 7,024,060.80 | 2.74 |
| 9  | 002050 | 三花智控 | 499,400   | 6,337,386.00 | 2.48 |
| 10 | 603993 | 洛阳钼业 | 1,683,900 | 6,331,464.00 | 2.47 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）   | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|-----------|--------------|
| 1  | 601860 | 紫金银行 | 15,970 | 50,145.80 | 0.02         |
| 2  | 603629 | 利通电子 | 1,051  | 40,684.21 | 0.02         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600104 | 上汽集团 | 30,752,653.38 | 12.02          |
| 2  | 002594 | 比亚迪  | 20,625,981.63 | 8.06           |
| 3  | 603799 | 华友钴业 | 16,696,426.61 | 6.52           |
| 4  | 002466 | 天齐锂业 | 16,459,330.22 | 6.43           |
| 5  | 300124 | 汇川技术 | 15,916,310.82 | 6.22           |
| 6  | 002460 | 赣锋锂业 | 14,650,528.64 | 5.72           |
| 7  | 600066 | 宇通客车 | 13,332,567.62 | 5.21           |
| 8  | 603993 | 洛阳钼业 | 9,816,391.90  | 3.84           |
| 9  | 000625 | 长安汽车 | 8,872,617.54  | 3.47           |
| 10 | 002050 | 三花智控 | 8,737,119.00  | 3.41           |
| 11 | 002340 | 格林美  | 8,545,899.10  | 3.34           |
| 12 | 300750 | 宁德时代 | 8,334,019.00  | 3.26           |
| 13 | 600699 | 均胜电子 | 8,156,966.52  | 3.19           |
| 14 | 600525 | 长园集团 | 8,021,989.06  | 3.13           |
| 15 | 002179 | 中航光电 | 7,687,147.88  | 3.00           |
| 16 | 600549 | 厦门钨业 | 6,499,917.75  | 2.54           |
| 17 | 600885 | 宏发股份 | 6,497,230.80  | 2.54           |
| 18 | 300450 | 先导智能 | 6,417,532.41  | 2.51           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 19 | 600884 | 杉杉股份 | 5,907,613.04 | 2.31 |
| 20 | 002176 | 江特电机 | 5,368,310.00 | 2.10 |
| 21 | 000887 | 中鼎股份 | 5,356,857.24 | 2.09 |
| 22 | 601238 | 广汽集团 | 5,313,288.60 | 2.08 |

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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     | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 600166 | 福田汽车 | 3,978,793.75 | 1.55           |
| 2  | 002176 | 江特电机 | 3,736,368.00 | 1.46           |
| 3  | 000559 | 万向钱潮 | 3,636,511.33 | 1.42           |
| 4  | 002594 | 比亚迪  | 3,386,388.33 | 1.32           |
| 5  | 600499 | 科达洁能 | 2,800,909.00 | 1.09           |
| 6  | 002497 | 雅化集团 | 2,786,600.00 | 1.09           |
| 7  | 600110 | 诺德股份 | 2,386,615.00 | 0.93           |
| 8  | 002192 | 融捷股份 | 1,709,210.00 | 0.67           |
| 9  | 002635 | 安洁科技 | 1,657,431.00 | 0.65           |
| 10 | 000762 | 西藏矿业 | 1,473,632.00 | 0.58           |
| 11 | 002240 | 威华股份 | 1,439,078.98 | 0.56           |
| 12 | 601127 | 小康股份 | 1,435,131.00 | 0.56           |
| 13 | 002245 | 澳洋顺昌 | 1,399,361.33 | 0.55           |
| 14 | 002190 | 成飞集成 | 1,367,849.00 | 0.53           |
| 15 | 000973 | 佛塑科技 | 1,293,569.58 | 0.51           |
| 16 | 002664 | 长鹰信质 | 1,264,822.00 | 0.49           |
| 17 | 600699 | 均胜电子 | 1,165,229.00 | 0.46           |
| 18 | 600104 | 上汽集团 | 1,155,265.85 | 0.45           |
| 19 | 300340 | 科恒股份 | 1,055,439.20 | 0.41           |
| 20 | 000868 | 安凯客车 | 917,048.80   | 0.36           |

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 386,898,410.47 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 56,237,708.72  |

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|--------------|
| 1  | 国家债券 | -    | -            |

|    |           |           |      |
|----|-----------|-----------|------|
| 2  | 央行票据      | -         | -    |
| 3  | 金融债券      | -         | -    |
|    | 其中：政策性金融债 | -         | -    |
| 4  | 企业债券      | -         | -    |
| 5  | 企业短期融资券   | -         | -    |
| 6  | 中期票据      | -         | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | 57,837.78 | 0.02 |
| 8  | 同业存单      | -         | -    |
| 9  | 其他        | -         | -    |
| 10 | 合计        | 57,837.78 | 0.02 |

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 123017 | 寒锐转债 | 594   | 57,837.78 | 0.02         |

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。



### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 92,489.73  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 4,550.42   |
| 5  | 应收申购款   | 65,206.79  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 162,246.94 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

### 8.12.6 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 8.12.7 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 公司名称 | 流通受限部分的公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------------|--------------|----------|
| 1  | 601860 | 紫金银行 | 50,145.80         | 0.02         | 新股流通受限   |

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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(%) |
| 汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF) A | 4,089    | 47,029.52 | 11,814,935.36 | 6.14      | 180,488,787.77 | 93.86     |
| 汇添富                   | 2,853    | 49,532.32 | 3,901,230.05  | 2.76      | 137,414,474.07 | 97.24     |

|                   |       |           |               |      |                |       |
|-------------------|-------|-----------|---------------|------|----------------|-------|
| 中证新能源汽车产业指数（LOF）C |       |           |               |      |                |       |
| 合计                | 6,942 | 48,058.11 | 15,716,165.41 | 4.71 | 317,903,261.84 | 95.29 |

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A

| 序号 | 持有人名称           | 持有份额（份）      | 占上市总份额比例（%） |
|----|-----------------|--------------|-------------|
| 1  | 叶伟华             | 1,193,430.00 | 2.15        |
| 2  | 曾凡华             | 1,010,538.00 | 1.82        |
| 3  | 黄海勇             | 995,384.00   | 1.79        |
| 4  | 耒阳市国有资产投资经营有限公司 | 995,249.00   | 1.79        |
| 5  | 廖秀银             | 995,114.00   | 1.79        |
| 6  | 关继泉             | 995,114.00   | 1.79        |
| 7  | 章聪              | 995,114.00   | 1.79        |
| 8  | 吴新容             | 995,069.00   | 1.79        |
| 9  | 陈新国             | 995,069.00   | 1.79        |
| 8  | 吴燕琼             | 995,069.00   | 1.79        |
| 10 | 杨雄              | 995,069.00   | 1.79        |

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份）      | 占上市总份额比例（%） |
|----|-------|--------------|-------------|
| 1  | 秦杰    | 1,130,050.00 | 5.00        |
| 2  | 应向群   | 1,000,270.00 | 4.42        |
| 3  | 韦雅萍   | 1,000,045.00 | 4.42        |
| 4  | 许逸生   | 500,157.00   | 2.21        |
| 5  | 黄赦慈   | 500,157.00   | 2.21        |
| 6  | 贾怀会   | 500,112.00   | 2.21        |
| 7  | 王辰    | 500,112.00   | 2.21        |
| 8  | 朱爱芬   | 410,334.00   | 1.81        |
| 9  | 杨迪航   | 400,126.00   | 1.77        |
| 10 | 邹海英   | 300,421.00   | 1.33        |

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别                 | 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 | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A | 35,803.03 | 0.02        |
|                  | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C | 5,020.22  | 0.00        |

|  |    |           |      |
|--|----|-----------|------|
|  | 合计 | 40,823.25 | 0.01 |
|--|----|-----------|------|

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 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 | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A | 0                 |
|                                | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C | 0                 |
|                                | 合计                   | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A | 0                 |
|                                | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C | 0                 |
|                                | 合计                   | 0                 |

#### 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,003,600.36 | 3.00            | 10,003,600.36 | 3.00            | 3 年        |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -               | -             | -               | -          |
| 基金经理等人员     | -             | -               | -             | -               | -          |
| 基金管理人股东     | -             | -               | -             | -               | -          |
| 其他          | 40,823.25     | 0.01            | -             | -               | -          |
| 合计          | 10,044,423.61 | 3.01            | 10,003,600.36 | 3.00            | -          |

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C |
|--------------------------------|----------------------|----------------------|
| 基金合同生效日（2018 年 5 月 23 日）基金份额总额 | 310,738,440.50       | 431,457,611.74       |
| 本报告期期初基金份额总额                   | -                    | -                    |
| 本报告期基金总申购                      | 5,767,092.85         | 5,776,826.10         |

|                          |                |                |
|--------------------------|----------------|----------------|
| 份额                       |                |                |
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 124,201,810.22 | 295,918,733.72 |
| 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             | 192,303,723.13 | 141,315,704.12 |

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 《汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 1 月 19 日正式生效，胡昕炜先生任该基金的基金经理。
2. 《汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 1 月 25 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。
3. 《汇添富熙和精选混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 2 月 11 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。
4. 《汇添富行业整合主题混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，赵鹏程先生任该基金的基金经理。
5. 《汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，陈健玮先生和劳杰男先生共同担任该基金的基金经理。
6. 《汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，陈加荣先生和胡娜女士共同担任该基金的基金经理。
7. 基金管理人于 2018 年 2 月 14 日公告，增聘胡娜女士为汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。
8. 基金管理人于 2018 年 3 月 2 日公告，劳杰男先生不再担任汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的基金经理，由李威先生单独管理该基金。
9. 基金管理人于 2018 年 3 月 2 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

10. 《汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 3 月 8 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生共同担任该基金的基金经理。
11. 基金管理人于 2018 年 3 月 20 日公告，增聘赵鹏飞先生为汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生和胡娜女士共同管理该基金。
12. 《汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 3 月 23 日正式生效，吴振翔先生和许一尊先生共同担任该基金的基金经理。
13. 基金管理人于 2018 年 4 月 3 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。
14. 《汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 4 月 16 日正式生效，吴江宏先生和胡娜女士共同担任该基金的基金经理。
15. 《汇添富智能制造股票型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 4 月 23 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。
16. 《汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 4 月 26 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
17. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，增聘徐寅喆女士为汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理，蒋文玲女士不再担任上述基金的基金经理。
18. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，增聘陶然先生为汇添富全额宝货币市场基金、汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，徐寅喆女士不再担任上述基金的基金经理。
19. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，增聘陶然先生为汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，陆文磊先生和徐寅喆女士不再担任该基金的基金经理。
20. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，增聘徐寅喆女士为汇添富货币市场基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理该基金。
21. 基金管理人于 2018 年 5 月 17 日公告，韩贤旺先生和欧阳沁春先生不再担任汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，由杨璿先生单独管理该基金。
22. 《汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同生效公告》于 2018 年 5 月 23 日正式生效，过蓓蓓女士任该基金的基金经理。
23. 基金管理人于 2018 年 5 月 29 日公告，聘任茹奕菡为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券

投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

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

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

26. 基金管理人于 2018 年 7 月 7 日公告，增聘曾刚先生和郑慧莲女士为汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，李怀定先生不再担任该基金的基金经理。

27. 基金管理人于 2018 年 7 月 7 日公告，增聘胡娜女士为汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）的基金经理，与陆文磊先生、李怀定先生共同管理该基金。

28. 基金管理人于 2018 年 7 月 7 日公告，增聘何旻先生、杨璠先生和刘江先生为汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理，与刘伟林先生共同管理该基金。

29. 基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告，李怀定先生不再担任汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的基金经理，由陆文磊先生和胡娜女士管理该基金。

30. 基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告，李怀定先生不再担任汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，由陆文磊先生单独管理上述基金。

31. 基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告，李怀定先生不再担任汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，由陆文磊先生、郑慧莲女士和胡娜女士管理该基金。

32. 基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告，李怀定先生不再担任汇添富睿丰混合型证券投资基金的基金经理，增聘蒋文玲女士为该基金的基金经理，与赵鹏飞先生共同管理该基金。

33. 基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告，李怀定先生不再担任汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理，由曾刚先生单独管理上述基金。

34. 基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告，增聘蒋文玲女士为汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，李怀定先生不再担任该基金的基金经理。

35. 基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告，李怀定先生不再担任汇添富盈鑫保本混合型证券

投资基金的基金经理，由何旻先生单独管理该基金。

36. 基金管理人于 2018 年 8 月 8 日公告，增聘温开强先生为汇添富理财 30 天债券型证券投资基金的基金经理，与徐寅喆女士共同管理该基金。

37. 《汇添富创新医药主题混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 8 月 8 日正式生效，刘江先生和郑磊先生共同担任该基金的基金经理。

38. 基金管理人于 2018 年 8 月 23 日公告，增聘徐光先生为汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，与陆文磊先生共同管理上述基金。

39. 《汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 9 月 21 日正式生效，陈健玮先生任该基金的基金经理。

40. 《汇添富全球消费行业混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 9 月 21 日正式生效，胡昕炜先生和郑慧莲女士共同担任该基金的基金经理。

41. 基金管理人于 2018 年 9 月 29 日公告，增聘吴江宏先生为汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生、郑慧莲女士共同管理上述基金。

42. 基金管理人于 2018 年 9 月 29 日公告，增聘徐光先生为汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理上述基金。

43. 《中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 10 月 23 日正式生效，过蓓蓓女士任该基金的基金经理。

44. 基金管理人于 2018 年 11 月 17 日公告，陈加荣先生不再担任汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，由吴江宏先生和郑慧莲女士管理上述基金。

45. 基金管理人于 2018 年 11 月 17 日公告，陈加荣先生不再担任汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金的基金经理，由徐光先生单独管理上述基金。

46. 基金管理人于 2018 年 11 月 17 日公告，陈加荣先生不再担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，由赵鹏飞先生和胡娜女士管理该基金。

47. 《汇添富经典成长定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 12 月 15 日正式生效，雷鸣先生任该基金的基金经理。

48. 《汇添富短债债券型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 12 月 13 日正式生效，蒋文玲女士任该基金的基金经理。

49. 《汇添富消费升级混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 12 月 21 日正式生效，胡昕炜先生和郑慧莲女士共同担任该基金的基金经理。

50. 《汇添富丰润中短债债券型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 12 月 24 日正式生效，徐光先生和蒋文玲女士共同担任该基金的基金经理。

51. 基金管理人于 2018 年 12 月 26 日公告，增聘茹奕菡女士为汇添富安心中国债券型证券投资基金的基金经理，与何旻先生共同管理该基金。

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

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

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

55. 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2018 年 5 月 23 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币捌万元整。



### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|-------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|       |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 东方证券  | 2      | 442,135,877.33 | 100.00%      | 406,276.43 | 100.00%    | -  |
| 中银国际  | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 东北证券  | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 东吴证券  | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 东兴证券  | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 广发证券  | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国海证券  | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国金证券  | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国泰君安  | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国信证券  | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 海通证券  | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 恒泰证券  | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 华泰证券  | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 华西证券  | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 联讯证券  | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 民族证券  | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 平安证券  | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 瑞银证券  | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 申万宏源证 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |

|       |   |   |   |   |   |   |
|-------|---|---|---|---|---|---|
| 券     |   |   |   |   |   |   |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 信达证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司  | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投  | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 江海证券  | 1 | - | - | - | - | - |

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易       |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              |
|------|------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额       | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券 | 342,433.00 | 100.00%      | 1,485,800,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 中银国际 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |
| 东北证券 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |
| 东吴证券 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |
| 东兴证券 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |
| 广发证券 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国海证券 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国金证券 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国泰君安 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国信证券 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |
| 海通证券 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |
| 恒泰证券 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |
| 华泰证券 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 华西证券       | - | - | - | - | - | - |
| 联讯证券       | - | - | - | - | - | - |
| 民族证券       | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券       | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券       | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源<br>证券 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券       | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券       | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司       | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投       | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券       | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券       | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券       | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券       | - | - | - | - | - | - |

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

（8）按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内退租 3 家证券公司的 3 个交易单元：东兴证券（上交所单元）、中投证券（上交所单元）、中信证券（深交所单元）。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

汇添富基金管理股份有限公司

2019 年 03 月 26 日