

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 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 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 信息披露方式	5
2.5 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	6
3.3 其他指标	错误!未定义书签。
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	43

7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	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权证投资明细	43
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12	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情况	45
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	45
§ 9	开放式基金份额变动	45
§ 10	重大事件揭示	46
10.1	基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4	基金投资策略的改变	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8	其他重大事件	48
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12	备查文件目录	50
12.1	备查文件目录	50
12.2	存放地点	50
12.3	查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	汇添富绝对收益定开混合
基金主代码	000762
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 15 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	794,594,155.87 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	基于基金管理人对市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。
投资策略	本基金采用包括市场中性投资策略在内的多种绝对收益策略，力争实现基金资产长期持续稳定的绝对回报。
业绩比较基准	一年期定期存款税后利率。
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，采用多种绝对收益策略，其中市场中性策略采用股指期货对冲市场风险，使得收益波动与市场相关性较低。因此，本基金属于中低风险水平追求绝对收益的投资品种，其预期风险低于股票型基金和一般的混合型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95555
传真	021-28932998	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	李文	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司
-------------	--------------------------------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 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(2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	48,268,389.56
本期利润	85,512,111.76
加权平均基金份额本期利润	0.0862
本期加权平均净值利润率	7.43%
本期基金份额净值增长率	7.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	169,123,035.00
期末可供分配基金份额利润	0.2128
期末基金资产净值	963,717,190.87
期末基金份额净值	1.213
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	21.30%

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

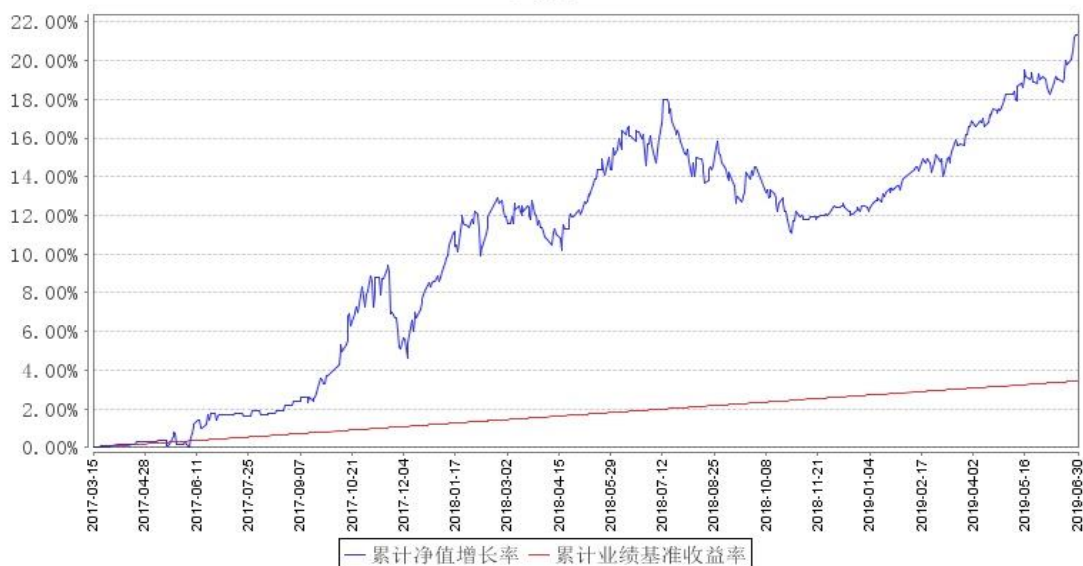
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.76%	0.26%	0.12%	0.00%	1.64%	0.26%

过去三个月	4.03%	0.24%	0.37%	0.00%	3.66%	0.24%
过去六个月	7.82%	0.24%	0.74%	0.00%	7.08%	0.24%
过去一年	4.84%	0.30%	1.50%	0.00%	3.34%	0.30%
自基金合同 生效日起至 今	21.30%	0.34%	3.44%	0.00%	17.86%	0.34%

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

汇添富绝对收益定开混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年03月15日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司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。目前，公司注册资本金为132,724,224元人民币。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。

2019 上半年，汇添富基金新成立 13 只公开募集证券投资基金，包括 5 只债券型基金、4 只混合型基金、2 只基金中基金、2 只指数基金联接基金。截至 2019 年 6 月 30 日，公司共管理 133 只公开募集证券投资基金，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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
顾耀强	汇添富策略回报混合基金、汇添富逆向投资混合基金、汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理。	2017年3月15日	-	15	国籍：中国。学历：清华大学管理学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任高级行业分析师、基金经理助理，2009年12月22日至今任汇添富策略回报混合基金的基金经理，2012年3月9日至今任汇添富逆向投资混合基金的基金经理，2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富均衡增

					长混合基金的基金经理，2016 年 7 月 27 日至 2019 年 1 月 18 日任汇添富沪港深新价值股票基金的基金经理，2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理。
吴江宏	汇添富可转换债券基金、汇添富盈安混合（原汇添富盈安保本混合）基金、汇添富盈稳保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富鑫利定开债、汇添富绝对收益定开混合、汇添富鑫益定开债、添富鑫汇定开债券基金、汇添富民丰回报混合、添富鑫永定开债、添富鑫盛定开债、添富年年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。	2017年3月15日	-	8	国籍：中国，学历：厦门大学经济学硕士。2011 年加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益分析师。2015 年 7 月 17 日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理，2016 年 4 月 19 日至今任汇添富盈安混合（原汇添富盈安保本混合）基金的基金经理，2016 年 8 月 3 日至今任汇添富盈稳保本混合基金的基金经理，2016 年 9 月 29 日至今任汇添富保鑫保本混合基金的基金经理，2017 年 3 月 13 日至今任汇添富鑫利定开债基金（原添富鑫利债券基金）的基金经理，2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理，2017 年 4 月 20 日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理，2017 年 6 月 23 日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理，2017 年 9 月 27

					<p>日至今任汇添富民丰回报混合基金的基金经理,2018 年 1 月 25 日至今任添富鑫永定开债基金的基金经理,2018 年 4 月 16 日至今任添富鑫盛定开债基金的基金经理,2018 年 9 月 28 日至今任添富年年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理,涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

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

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任

何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的交易次数为 5 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

上半年市场震荡上行：上证 50 指数上涨 27.80%，沪深 300 指数上涨 27.07%，中证 500 指数上涨 18.77%。中美贸易争端缓和及国内托底经济政策支持了市场上涨，但贸易谈判进展的反复导致了市场的较大波动。受外需影响不大的食品饮料、社会服务等行业表现较好，与经济相关性较大的一些周期性行业表现较差。此外，受非洲猪瘟影响，畜禽养殖类公司整体涨幅较大。

随着监管层进一步推动股指期货市场正常化，上半年股指期货的成交和持仓持续恢复，对冲成本不断降低，本基金渐进提高了股票对冲的仓位。上半年本基金基于基本面选股构建的投资组合取得了一定阿尔法收益。同时基于市场判断适度保持了一定股票多头暴露，在上半年市场中也有了一定贡献。上半年固收投资收益主要来自票息，一季度降组合久期，并参与可转债投资，贡献了一定超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末基金份额净值为 1.213 元，本报告期基金份额净增长率为 7.82%，同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济增长有压力但政策有能力托底，美联储降息预期将支持全球流动性环境整体偏暖，预计市场将呈震荡分化格局。中美贸易争端的演进仍是最大不确定性因素。从投资角度来看，在投资者结构变化和发行等制度改革推动下，商业模式好、治理结构优秀、盈利增长持续性和确定性强的优质公司将成为稀缺的核心资产，继续为全球投资者重点关注。

展望下半年，债市将维持震荡偏强的走势。国内经济呈现供需两弱的格局，经济下行压力仍大，货币政策维持偏松基调的确定性较高，有利于债券收益率下行。海外方面，全球央行加码宽松，国内货币政策空间加大。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；封闭期，基金收益分配采用现金分红；开放期，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	50,936,683.05	5,657,506.17
结算备付金		27,591,266.21	16,391,245.80
存出保证金		44,655,560.21	30,683,542.03
交易性金融资产	6.4.7.2	881,636,797.10	1,212,538,155.79
其中：股票投资		498,534,250.52	376,253,190.79
基金投资		-	-
债券投资		383,102,546.58	836,284,965.00
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	9,416,758.22	9,307,708.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,014,237,064.79	1,274,578,158.19
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2019 年 6 月 30 日	2018 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		10,000,000.00	300,000.00
应付证券清算款		38,098,825.99	5,284,569.18
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,169,458.24	1,611,001.86
应付托管费		194,909.72	268,500.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	684,955.48	426,066.19
应交税费		36,561.80	77,532.55
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	335,162.69	390,000.00
负债合计		50,519,873.92	8,357,670.09
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	794,594,155.87	1,125,878,706.70
未分配利润	6.4.7.10	169,123,035.00	140,341,781.40
所有者权益合计		963,717,190.87	1,266,220,488.10
负债和所有者权益总计		1,014,237,064.79	1,274,578,158.19

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.213 元，基金份额总额 794,594,155.87 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		98,159,020.97	22,678,116.56
1. 利息收入		11,576,664.24	2,256,032.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	259,301.94	74,851.06
债券利息收入		11,295,109.53	2,156,497.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		22,252.77	24,684.45
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		48,621,625.79	31,094,712.46

其中：股票投资收益	6.4.7.12	101,673,797.79	23,529,508.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	16,477,626.10	1,786,885.31
资产支持证券投资收 益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-75,174,102.06	4,715,333.56
股利收益	6.4.7.16	5,644,303.96	1,062,984.70
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	6.4.7.17	37,243,722.20	-10,786,360.68
4. 汇兑收益(损失以“-”号 填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号 填列)	6.4.7.18	717,008.74	113,732.04
减：二、费用		12,646,909.21	4,052,601.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,538,206.17	2,171,357.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,423,034.42	361,892.91
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,419,216.89	1,274,493.98
5. 利息支出		46,736.30	3,521.67
其中：卖出回购金融资产支出		46,736.30	3,521.67
6. 税金及附加		55,660.26	22,244.07
7. 其他费用	6.4.7.20	164,055.17	219,091.91
三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)		85,512,111.76	18,625,514.77

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：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

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者 权益(基金净值)	1,125,878,706.70	140,341,781.40	1,266,220,488.10
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数(本期 利润)	-	85,512,111.76	85,512,111.76
三、本期基金份 额交易产生的基 金净值变动数 (净值减少以	-331,284,550.83	-56,730,858.16	-388,015,408.99

“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	197,347,854.47	35,257,430.35	232,605,284.82
2. 基金赎回款	-528,632,405.30	-91,988,288.51	-620,620,693.81
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）	794,594,155.87	169,123,035.00	963,717,190.87
项目	上年度可比期间		
	2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	293,313,235.23	25,304,116.85	318,617,352.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,625,514.77	18,625,514.77
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）	-62,266,874.11	-7,694,873.48	-69,961,747.59
其中：1. 基金申购款	91,746,944.33	10,550,973.73	102,297,918.06
2. 基金赎回款	-154,013,818.44	-18,245,847.21	-172,259,665.65
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）	231,046,361.12	36,234,758.14	267,281,119.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

李骁

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]741号文《关于核准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募集的批复》准予注册，以及中国证券监督管理委员会机构部函[2016]2980号文《关于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延期募集备案的回函》准予延期募集，由汇添富基金管理股份有限公司作为基金发起人于2017年2月20日至2017年3月10日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2017)验字第60466941_B11号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2017年3月15日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币493,191,557.82元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币122,306.67元，以上实收基金（本息）合计为人民币493,313,864.49元，折合493,313,864.49份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等，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）。本基金基于基金管理人对市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。本基金的业绩比较基准为：一年期定期存款税后利率。

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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

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

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

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

融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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。

6.4.6.3 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、营业税的单位和个人，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。

6.4.6.4 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。

6.4.6.5 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。

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 2019年6月30日
活期存款	50,936,683.05
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	50,936,683.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	449,916,052.91	498,534,250.52	48,618,197.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	307,482,546.58	4,182,645.37
	银行间市场	75,620,000.00	567,395.35
	合计	383,102,546.58	4,750,040.72
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	828,268,558.77	881,636,797.10	53,368,238.33

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-413,053,232.89	-	-	
其中：股指期货投资	-413,053,232.89	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-413,053,232.89	-	-	

注：本期末 2019 年 6 月 30 日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量(买/卖)	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
IC1909	-50	-47,714,888.89	-48,136,000.00	-421,111.11
IF1909	-300	-322,613,460.00	-341,262,000.00	-18,648,540.00
IH1909	-50	-42,724,884.00	-43,560,000.00	-835,116.00
总额合计：			-19,904,767.11	
减：可抵销期货暂收款			-19,904,767.11	
股指期货投资净额：			0.00	

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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：本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

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 2019年6月30日

应收活期存款利息	5,778.99
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	14,935.15
应收债券利息	9,395,865.38
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	178.70
合计	9,416,758.22

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	684,080.48
银行间市场应付交易费用	875.00
合计	684,955.48

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付信息披露费	290,531.71
应付审计费	44,630.98
合计	335,162.69

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,125,878,706.70	1,125,878,706.70
本期申购	197,347,854.47	197,347,854.47
本期赎回（以“-”号填列）	-528,632,405.30	-528,632,405.30
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	794,594,155.87	794,594,155.87

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	223,412,326.86	-83,070,545.46	140,341,781.40
本期利润	48,268,389.56	37,243,722.20	85,512,111.76
本期基金份额交易产生的变动数	-63,299,737.90	6,568,879.74	-56,730,858.16
其中：基金申购款	43,363,107.50	-8,105,677.15	35,257,430.35
基金赎回款	-106,662,845.40	14,674,556.89	-91,988,288.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	208,380,978.52	-39,257,943.52	169,123,035.00

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	92,581.03
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	159,264.89
其他	7,456.02
合计	259,301.94

注：表中“其他”指直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	795,821,039.36
减：卖出股票成本总额	694,147,241.57
买卖股票差价收入	101,673,797.79

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	690,639,538.43
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	663,470,769.33
减：应收利息总额	10,691,143.00

买卖债券差价收入	16,477,626.10
----------	---------------

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注:本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注:本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注:本基金本报告期无买卖权证价差收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位:人民币元

项目	本期收益金额 2019年1月1日至2019年6月30日
股指期货投资收益	-75,174,102.06

6.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,644,303.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,644,303.96

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	72,095,706.68
股票投资	76,551,893.74
债券投资	-4,456,187.06
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-34,851,984.48
权证投资	-
期货	-34,851,984.48
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	37,243,722.20

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	717,008.74
合计	717,008.74

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	2,417,116.89
银行间市场交易费用	2,100.00
合计	2,419,216.89

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	90,531.71
账户维护费	18,600.00
银行费用	10,292.48
合计	164,055.17

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、基金发起人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	171,802,356.17	11.19	110,344,917.27	13.74

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	357,346,397.86	58.82	76,785,930.78	36.61

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	59,200,000.00	9.76	7,000,000.00	5.11

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日

	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	158,714.52	11.30	86,931.53	12.69
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	101,505.34	13.70	77,568.55	33.24

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,538,206.17	2,171,357.25
其中:支付销售机构的客户维护费	2,515,615.88	704,244.64

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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,由基金管理人与基金托管人核对一致后,基金托管人于次月前三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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,423,034.42	361,892.91

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

$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月前三个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2017 年 3 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,000.00	10,001,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,000.00	10,001,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份	1.26%	4.33%

额比例	
-----	--

注：本公司于 2017 年 3 月 10 日用自有资金 10,001,000.00 元认购本基金份额 10,001,000.00 份（含募集期利息结转的份额），认购费用 0.00 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	50,936,683.05	92,581.03	7,058,710.55	37,399.01

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

注：本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末(2019 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113028	环境转债	2019 年 6 月 20 日	2019 年 7 月 8 日	新债流通受限	100.00	100.00	2,750	275,000.00	275,000.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注:截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 10,000,000.00 元,于 2019 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构,并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	51,250,199.20	-
合计	51,250,199.20	-

注：未评级债券为超短期融资券、国债、中央银行票据以及政策性金融债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	52,215,410.80	-
AAA 以下	258,454,236.58	-
未评级	21,182,700.00	-
合计	331,852,347.38	-

注：未评级债券为超短期融资券、国债、中央银行票据以及政策性金融债。

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于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、债券投资、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	50,936,683.05	-	-	-	-	-	50,936,683.05
结算备付金	27,591,266.21	-	-	-	-	-	27,591,266.21
存出保证金	397,040.21	-	-	-	-	44,258,520.00	44,655,560.21
交易性金融资产	-	40,248,000.00	116,867,346.58	225,987,200.00	-	498,534,250.52	881,636,797.10
应收利息	-	-	-	-	-	9,416,758.22	9,416,758.22

资产总计	78,924,989.47	40,248,000.00	116,867,346.58	225,987,200.00	-	552,209,528.74	1,014,237,064.79
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,169,458.24	1,169,458.24
应付托管费	-	-	-	-	-	194,909.72	194,909.72
应付证券清算款	-	-	-	-	-	38,098,825.99	38,098,825.99
卖出回购金融资产款	10,000,000.00	-	-	-	-	-	10,000,000.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	684,955.48	684,955.48
应交税费	-	-	-	-	-	36,561.80	36,561.80
其他负债	-	-	-	-	-	335,162.69	335,162.69
负债总计	10,000,000.00	-	-	-	-	40,519,873.92	50,519,873.92
利率敏感度缺口	68,924,989.47	40,248,000.00	116,867,346.58	225,987,200.00	-	511,689,654.82	963,717,190.87
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行	5,657,506.	-	-	-	-	-	-5,657,506.17

存款	17						
结算 备付 金	16,391,245 .80	-	-	-	-	-	16,391,245.8 0
存出 保证 金	159,142.03	-	-	-	-	30,524,400. 00	30,683,542.0 3
交易 性金 融资 产	10,137,204 .20	14,967,000. 00	171,551,46 0.80	523,854,300 .00	115,775,000 .00	376,253,190 .79	1,212,538,15 5.79
应收 利息	-	-	-	-	-	9,307,708.4 0	9,307,708.40
资产 总计	32,345,098 .20	14,967,000. 00	171,551,46 0.80	523,854,300 .00	115,775,000 .00	416,085,299 .19	1,274,578,15 8.19
负债							
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	1,611,001.8 6	1,611,001.86
应付 托管 费	-	-	-	-	-	268,500.31	268,500.31
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	5,284,569.1 8	5,284,569.18
卖出 回购 金融 资产 款	300,000.00	-	-	-	-	-	300,000.00
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	426,066.19	426,066.19
应付 税费	-	-	-	-	-	77,532.55	77,532.55
其他 负债	-	-	-	-	-	390,000.00	390,000.00
负债 总计	300,000.00	-	-	-	-	8,057,670.0 9	8,357,670.09
利率 敏感 度缺	32,045,098 .20	14,967,000. 00	171,551,46 0.80	523,854,300 .00	115,775,000 .00	408,027,629 .10	1,266,220,48 8.10

□							
---	--	--	--	--	--	--	--

注：上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	4. 银行存款、结算备付金、存出保证金均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；		
	5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
	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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
分析	基准利率增加 25 个基点	-1,210,703.78	-5,924,887.44
	基准利率减少 25 个基点	1,220,762.56	6,013,572.67

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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	498,534,250.52	51.73	376,253,190.79	29.71
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	383,102,546.58	39.75	836,284,965.00	66.05
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	881,636,797.10	91.48	1,212,538,155.79	95.76

注：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%—120%之间。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
	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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	沪深 300 指数上涨 5%	4,897,284.35	9,394,262.03

	沪深 300 指数下降 5%	-4,897,284.35	-9,394,262.03
--	-------------------	---------------	---------------

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

截止资产负债表日，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	498,534,250.52	49.15
	其中：股票	498,534,250.52	49.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	383,102,546.58	37.77
	其中：债券	383,102,546.58	37.77
	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	78,527,949.26	7.74
8	其他各项资产	54,072,318.43	5.33
9	合计	1,014,237,064.79	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	7,759,900.00	0.81
B	采矿业	23,831,043.69	2.47
C	制造业	235,451,112.65	24.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	993,000.00	0.10
E	建筑业	3,715,000.00	0.39

F	批发和零售业	13,497,460.00	1.40
G	交通运输、仓储和邮政业	7,540,200.00	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,472,455.12	3.06
J	金融业	131,951,837.46	13.69
K	房地产业	16,448,000.00	1.71
L	租赁和商务服务业	20,911,135.00	2.17
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	4,626,000.00	0.48
R	文化、体育和娱乐业	2,337,106.60	0.24
S	综合	-	-
	合计	498,534,250.52	51.73

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	388,000	34,380,680.00	3.57
2	601166	兴业银行	1,500,000	27,435,000.00	2.85
3	000661	长春高新	50,000	16,900,000.00	1.75
4	000333	美的集团	250,000	12,965,000.00	1.35
5	600030	中信证券	500,000	11,905,000.00	1.24
6	600519	贵州茅台	12,000	11,808,000.00	1.23
7	000858	五粮液	100,000	11,795,000.00	1.22
8	601398	工商银行	1,880,000	11,073,200.00	1.15
9	000651	格力电器	180,000	9,900,000.00	1.03
10	600887	伊利股份	288,000	9,622,080.00	1.00
11	002311	海大集团	299,001	9,239,130.90	0.96
12	002142	宁波银行	380,000	9,211,200.00	0.96
13	600570	恒生电子	130,057	8,863,384.55	0.92
14	000001	平安银行	600,000	8,268,000.00	0.86
15	000568	泸州老窖	100,000	8,083,000.00	0.84
16	601601	中国太保	220,000	8,032,200.00	0.83
17	601699	潞安环能	999,926	7,939,412.44	0.82
18	000961	中南建设	900,000	7,794,000.00	0.81

19	600809	山西汾酒	109,968	7,593,290.40	0.79
20	600009	上海机场	90,000	7,540,200.00	0.78
21	601899	紫金矿业	2,000,000	7,540,000.00	0.78
22	601939	建设银行	1,000,000	7,440,000.00	0.77
23	002475	立讯精密	300,000	7,437,000.00	0.77
24	300498	温氏股份	200,000	7,172,000.00	0.74
25	300662	科锐国际	200,000	7,084,000.00	0.74
26	601888	中国国旅	79,900	7,083,135.00	0.73
27	000703	恒逸石化	500,000	6,830,000.00	0.71
28	002127	南极电商	600,000	6,744,000.00	0.70
29	603605	珀莱雅	100,000	6,618,000.00	0.69
30	002410	广联达	200,000	6,578,000.00	0.68
31	600298	安琪酵母	200,000	6,326,000.00	0.66
32	603883	老百姓	108,000	6,315,840.00	0.66
33	002179	中航光电	179,954	6,021,260.84	0.62
34	000786	北新建材	319,926	5,800,258.38	0.60
35	002415	海康威视	200,000	5,516,000.00	0.57
36	601336	新华保险	100,000	5,503,000.00	0.57
37	601933	永辉超市	500,000	5,105,000.00	0.53
38	300285	国瓷材料	299,915	5,101,554.15	0.53
39	300451	创业慧康	329,999	4,933,485.05	0.51
40	300347	泰格医药	60,000	4,626,000.00	0.48
41	600436	片仔癀	39,900	4,596,480.00	0.48
42	300450	先导智能	129,975	4,367,160.00	0.45
43	600985	淮北矿业	380,000	4,309,200.00	0.45
44	600585	海螺水泥	100,000	4,150,000.00	0.43
45	002050	三花智控	388,000	4,093,400.00	0.42
46	600801	华新水泥	200,000	4,050,000.00	0.42
47	000063	中兴通讯	116,000	3,773,480.00	0.39
48	600845	宝信软件	129,887	3,699,181.76	0.38
49	600660	福耀玻璃	160,000	3,636,800.00	0.38
50	601288	农业银行	1,000,000	3,600,000.00	0.37
51	000401	冀东水泥	200,000	3,522,000.00	0.37
52	000069	华侨城A	500,000	3,475,000.00	0.36
53	600132	重庆啤酒	70,000	3,301,200.00	0.34
54	601233	桐昆股份	201,052	3,118,316.52	0.32
55	002563	森马服饰	280,058	3,097,441.48	0.32
56	600867	通化东宝	200,000	3,080,000.00	0.32
57	300014	亿纬锂能	100,000	3,046,000.00	0.32
58	600161	天坛生物	120,000	3,030,000.00	0.31
59	601012	隆基股份	129,916	3,002,358.76	0.31
60	600837	海通证券	200,000	2,838,000.00	0.29

61	300010	立思辰	300,000	2,817,000.00	0.29
62	600498	烽火通信	100,000	2,786,000.00	0.29
63	300124	汇川技术	120,000	2,749,200.00	0.29
64	603501	韦尔股份	50,000	2,745,500.00	0.28
65	300601	康泰生物	50,000	2,625,000.00	0.27
66	600031	三一重工	200,000	2,616,000.00	0.27
67	600048	保利地产	200,000	2,552,000.00	0.26
68	000708	大冶特钢	200,000	2,540,000.00	0.26
69	002440	闰土股份	200,000	2,492,000.00	0.26
70	000807	云铝股份	500,000	2,345,000.00	0.24
71	300144	宋城演艺	100,000	2,314,000.00	0.24
72	601688	华泰证券	99,986	2,231,687.52	0.23
73	603708	家家悦	91,000	2,076,620.00	0.22
74	601088	中国神华	100,000	2,038,000.00	0.21
75	601186	中国铁建	200,000	1,990,000.00	0.21
76	002001	新 和 成	100,000	1,929,000.00	0.20
77	601668	中国建筑	300,000	1,725,000.00	0.18
78	300579	数字认证	59,950	1,678,600.00	0.17
79	600028	中国石化	300,000	1,641,000.00	0.17
80	000560	我爱我家	300,000	1,434,000.00	0.15
81	002371	北方华创	20,000	1,385,000.00	0.14
82	002916	深南电路	12,000	1,223,040.00	0.13
83	600383	金地集团	100,000	1,193,000.00	0.12
84	601989	中国重工	200,000	1,112,000.00	0.12
85	600025	华能水电	200,000	814,000.00	0.08
86	601799	星宇股份	10,100	797,496.00	0.08
87	600276	恒瑞医药	10,000	660,000.00	0.07
88	300750	宁德时代	8,800	606,144.00	0.06
89	002422	科伦药业	20,000	594,600.00	0.06
90	002714	牧原股份	10,000	587,900.00	0.06
91	600085	同仁堂	20,000	580,000.00	0.06
92	002439	启明星辰	20,000	538,000.00	0.06
93	603345	安井食品	10,000	514,000.00	0.05
94	600600	青岛啤酒	10,000	499,300.00	0.05
95	600893	航发动力	20,000	454,200.00	0.05
96	300122	智飞生物	10,000	431,000.00	0.04
97	000825	太钢不锈	100,000	407,000.00	0.04
98	600019	宝钢股份	60,000	390,000.00	0.04
99	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.04
100	002008	大族激光	10,000	343,800.00	0.04
101	300059	东方财富	24,000	325,200.00	0.03
102	603043	广州酒家	10,000	323,300.00	0.03

103	002507	涪陵榨菜	10,000	305,000.00	0.03
104	002557	洽洽食品	10,000	252,500.00	0.03
105	600900	长江电力	10,000	179,000.00	0.02
106	000338	潍柴动力	10,030	123,268.70	0.01
107	000538	云南白药	1,000	83,420.00	0.01
108	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
109	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
110	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
111	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
112	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002142	宁波银行	21,326,929.68	1.68
2	601688	华泰证券	18,611,486.30	1.47
3	000858	五粮液	16,832,044.00	1.33
4	600030	中信证券	16,556,000.00	1.31
5	603816	顾家家居	14,934,885.19	1.18
6	600887	伊利股份	14,611,135.80	1.15
7	600570	恒生电子	13,887,533.00	1.10
8	000651	格力电器	13,849,263.37	1.09
9	601318	中国平安	13,674,537.00	1.08
10	000703	恒逸石化	13,146,800.20	1.04
11	600519	贵州茅台	13,122,374.76	1.04
12	002475	立讯精密	12,827,493.00	1.01
13	002714	牧原股份	12,670,609.00	1.00
14	000001	平安银行	12,307,597.80	0.97
15	600426	华鲁恒升	12,272,107.21	0.97
16	600031	三一重工	11,508,768.88	0.91
17	000401	冀东水泥	11,287,743.00	0.89
18	000333	美的集团	10,825,554.60	0.85
19	600809	山西汾酒	10,440,215.84	0.82
20	300059	东方财富	9,679,118.00	0.76

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	34,970,588.12	2.76
2	601318	中国平安	27,884,584.97	2.20

3	600519	贵州茅台	24,981,210.00	1.97
4	601688	华泰证券	24,434,135.59	1.93
5	002142	宁波银行	22,861,902.03	1.81
6	601888	中国国旅	20,863,026.40	1.65
7	000661	长春高新	20,786,566.80	1.64
8	600426	华鲁恒升	17,651,432.99	1.39
9	603816	顾家家居	16,483,670.53	1.30
10	600031	三一重工	15,874,475.59	1.25
11	600887	伊利股份	14,111,009.20	1.11
12	002714	牧原股份	13,983,646.00	1.10
13	600009	上海机场	13,622,424.31	1.08
14	603658	安图生物	12,871,826.54	1.02
15	600030	中信证券	12,262,752.76	0.97
16	601088	中国神华	12,089,722.00	0.95
17	300059	东方财富	11,645,500.00	0.92
18	601668	中国建筑	11,478,000.00	0.91
19	600585	海螺水泥	11,309,428.00	0.89
20	000858	五粮液	11,237,690.56	0.89

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	739,876,407.56
卖出股票收入（成交）总额	795,821,039.36

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	20,984,199.20	2.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	21,182,700.00	2.20
	其中：政策性金融债	21,182,700.00	2.20
4	企业债券	263,033,500.00	27.29
5	企业短期融资券	30,266,000.00	3.14
6	中期票据	29,997,000.00	3.11
7	可转债（可交换债）	17,639,147.38	1.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	383,102,546.58	39.75

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	155030	18 三友 03	300,000	30,771,000.00	3.19
2	143844	18 南港 02	300,000	30,012,000.00	3.11
3	101669035	16 乐普 MTN001	300,000	29,997,000.00	3.11
4	018007	国开 1801	210,000	21,182,700.00	2.20
5	019611	19 国债 01	210,010	20,984,199.20	2.18

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IH1909	IH1909	-50	-43,560,000.00	-835,116.00	-
IC1909	IC1909	-50	-48,136,000.00	-421,111.11	-
IF1909	IF1909	-300	-341,262,000.00	-18,648,540.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-19,904,767.11
股指期货投资本期收益（元）					-75,174,102.06
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-34,851,984.48

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资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。

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	44,655,560.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,416,758.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,072,318.43

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113014	林洋转债	3,828,400.00	0.40

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
12,989	61,174.39	255,184,746.63	32.12	539,409,409.24	67.88

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	1,788,849.80	0.23

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	50~100

8.4 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	10,001,000.00	1.26	10,001,000.00	1.26	3 年
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	884,955.75	0.11	884,955.75	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	903,894.05	0.11	903,894.05	-	-
合计	11,789,849.80	1.48	10,001,000.00	-	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 3 月 15 日） 基金份额总额	493,313,864.49
本报告期期初基金份额总额	1,125,878,706.70
本报告期基金总申购份额	197,347,854.47
减：本报告期基金总赎回份额	528,632,405.30
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	794,594,155.87

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，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。

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	
天风证券	2	302,125,528.46	19.68%	280,119.04	19.94%	-
中信建投	2	239,206,027.87	15.58%	219,660.83	15.64%	-
东方证券	2	171,802,356.17	11.19%	158,714.52	11.30%	-
招商证券	2	135,586,495.69	8.83%	125,116.45	8.91%	-
西藏东方财	2	101,796,945.45	6.63%	83,609.62	5.95%	-

富						
北京高华	2	94,379,140.70	6.15%	86,571.52	6.16%	-
广发证券	3	91,184,607.92	5.94%	84,351.08	6.01%	-
东北证券	2	90,069,214.33	5.87%	82,893.44	5.90%	-
海通证券	2	88,552,931.21	5.77%	81,343.46	5.79%	-
安信证券	2	69,260,948.82	4.51%	64,131.09	4.57%	-
国泰君安	2	62,636,761.14	4.08%	57,304.47	4.08%	-
中信证券	2	41,835,026.64	2.73%	38,129.28	2.71%	-
国金证券	2	23,695,218.06	1.54%	21,753.17	1.55%	-
国信证券	2	17,049,039.69	1.11%	15,703.23	1.12%	-
申万宏源证 券	2	5,682,480.04	0.37%	5,279.04	0.38%	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
天风证券	58,627,989.40	9.65%	220,500,000.00	36.36%	-	-
中信建投	55,839,247.92	9.19%	102,300,000.00	16.87%	-	-
东方证券	357,346,397.86	58.82%	59,200,000.00	9.76%	-	-
招商证券	29,605,691.40	4.87%	60,000,000.00	9.89%	-	-
西藏东方 财富	1,139,425.12	0.19%	45,500,000.00	7.50%	-	-
北京高华	4,995,175.84	0.82%	30,000,000.00	4.95%	-	-
广发证券	6,375,000.00	1.05%	80,000,000.00	13.19%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	26,086,923.80	4.29%	4,000,000.00	0.66%	-	-

安信证券	1,585,891.13	0.26%	3,000,000.00	0.49%	-	-
国泰君安	-	-	2,000,000.00	0.33%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	64,581,906.05	10.63%	-	-	-	-
申万宏源 证券	1,330,329.00	0.22%	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。
- (8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内新增 2 家证券公司的 4 个交易单元：中信建投（上交所单元和深交所单元）、中原证券（上交所单元和深交所单元）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2018 年资产净值的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-01-01

2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加珠海华润银行为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-01-05
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下 115 只基金 2018 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, 证券日报	2019-01-21
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东莞农商银行为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-02-01
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加前海财厚为代销机构并参与费率优惠活动的公告	证券时报, 公司网站	2019-03-22
6	汇添富基金旗下 115 只基金 2018 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, 证券日报	2019-03-26
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中证报, 公司网站	2019-04-02
8	关于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增加腾安基金销售为代销机构的公告	上证报, 公司网站	2019-04-04
9	关于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第四次开放申购、赎回和转换业务的公告	上证报, 公司网站	2019-04-15
10	关于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通过网上直销申购费率优惠的公告	上证报, 公司网站	2019-04-17
11	汇添富基金旗下 123 只基金 2019 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, 证券日报	2019-04-20
12	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更新招募说明书(2019 年第 1 号)	上证报, 公司网站	2019-04-27
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	上证报, 公司网站	2019-05-21

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注:无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《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基金合同》；
- 3、《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托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 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

2019 年 8 月 29 日