

汇添富香港优势精选混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 08 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。

基金托管人中国工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 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	34
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	35
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	38

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细	41
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	41
7.11 投资组合报告附注.....	41
§ 8 基金份额持有人信息.....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	42
§9 开放式基金份额变动.....	42
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件.....	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
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	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§ 12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富香港优势精选混合型证券投资基金
基金简称	汇添富香港优势精选混合(QDII)
基金主代码	470888
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月25日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	163,050,830.21 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在香港证券市场精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的公司股票等证券，通过有效的资产配置和组合管理，进行中长期投资布局，在有效管理风险的前提下，追求持续稳健的较高投资回报。
投资策略	本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出具有持续竞争优势，且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。
业绩比较基准	MSCI 中华指数 (MSCI ZhongHua Index)。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95588
传真	021-28932998	010-66105798
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	李文	陈四清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼

§ 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 01 月 01 日-2019 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	-4,762,150.46
本期利润	19,621,487.04
加权平均基金份额本期利润	0.1184
本期加权平均净值利润率	12.75%
本期基金份额净值增长率	13.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	-3,454,311.94
期末可供分配基金份额利润	-0.0212
期末基金资产净值	159,596,518.27
期末基金份额净值	0.979
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 06 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	11.32%
-------------	--------

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

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

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

3.2 基金净值表现

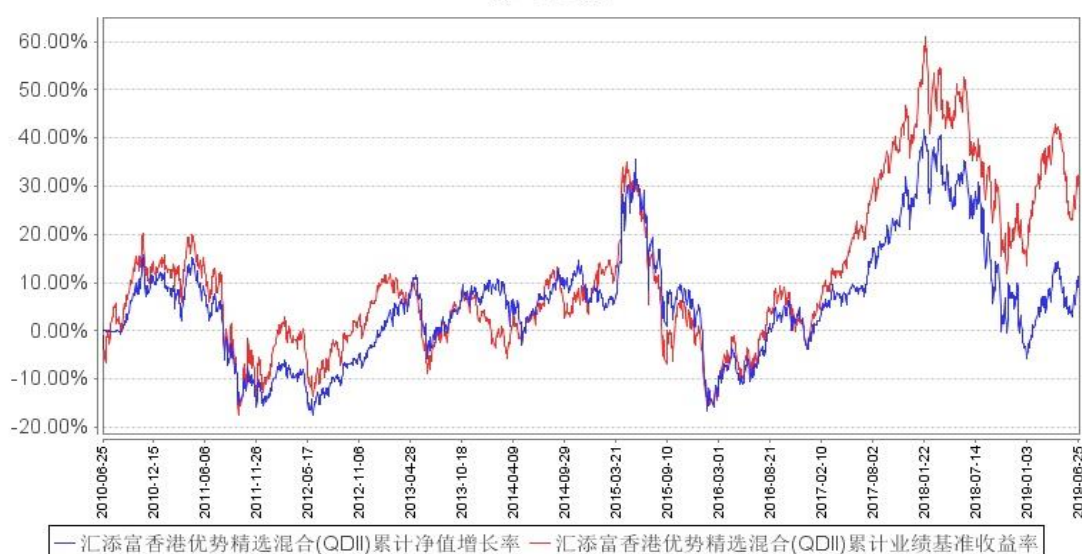
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.99%	1.00%	7.17%	1.09%	-0.18%	-0.09%
过去三个月	1.77%	1.05%	-4.00%	1.00%	5.77%	0.05%
过去六个月	13.70%	1.01%	12.33%	1.05%	1.37%	-0.04%
过去一年	-12.98%	1.44%	-5.23%	1.27%	-7.75%	0.17%
过去三年	20.34%	1.15%	39.52%	1.05%	-19.18%	0.10%
自基金合同生效起至今	11.32%	1.07%	31.92%	1.14%	-20.60%	-0.07%

注：本基金的《基金合同》生效日为2010年6月25日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富香港优势精选混合(QDII)累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2010年6月25日）起6个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司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		
倪健	原汇添富香港优势精选混合基金、添富港股通专注成长基金的基金经理。	2015年10月27日	2019年1月1日	16年	国籍：中国，学历：美国哥伦比亚大学公共管理硕士，清华大学工程硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格，特许金融分析师（CFA），财务风险经理人（FRM）。 从业经历：曾任中国银河证券有限责任公司投资银行总部、股票发行部业务经理，中信证券国际资产管理（香港）有限公司投资分析员，五矿资本（香港）有限公司投资组合经理。2015年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，2015年10月27日起至2019年1月1日任汇添富香港优势精选混合基金的基金经理，2017年11月10日至2019年1月1日任添富港股通专注成长

					基金的基金经理。
杨威风	添富港股通专注成长、汇添富香港优势精选混合(QDII)、汇添富沪港深新价值股票的基金经理, 汇添富资产管理(香港)有限公司股票投资副总监	2019年1月1日		12年	国籍: 中国。学历: 香港大学工商管理学硕士。相关业务资格: 证券从业资格。从业经历: 曾任东兴证券香港公司自营部投资总监职务, 香港广发资产管理基金经理助理, 瑞士信贷投资银行股票分析师。2017年12月加入汇添富资产管理(香港)有限公司, 任股票投资副总监, 2019年1月1日至今任添富港股通专注成长、汇添富香港优势精选混合(QDII)的基金经理, 2019年1月18日至今任汇添富沪港深新价值股票的基金经理。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注: 本基金无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.4.2 异常交易行为的专项说明

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

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年，香港恒生指数上涨 10.4%至 28543 点。截至 2019 年 6 月 28 日，本基金净值上涨 13.7%，同期恒生指数按人民币计价上涨 10.6%，跑赢指数 3.1%。

港股市场经过一季度的上涨后，二季度表现较为波动。首先，中美贸易谈判在一些核心问题上并未谈成结果，虽然近期有缓和迹象，但估计贸易磨擦将长期化，甚至有可能往其它领域伸延。另一方面，由于全球经济增速有放缓的预期，相信美联储及中国人民银行将采取宽松的货币政策，主基调将从去年的去杠杆变成今年的稳增长，希望能对实体经济起到缓冲作用，降低硬着陆的风险。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富香港优势精选混合(QDII)份额净值为 0.979 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.70%；同期业绩比较基准收益率为 12.33%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中美贸易磨擦等因素有可能延续，但同时间由于流动性的释放，相信一些对利率敏感性的防御性行业能收益。在组合配置方面，后续将更着重自下而上选股，并加强挖掘有较强抗风险能力的企业。

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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 25%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富香港优势精选混合型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富香港优势精选混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 06 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	20,467,072.77	26,546,628.60
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	137,983,731.47	119,034,573.84
其中：股票投资		137,983,731.47	119,034,573.84
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,387,226.49	-
应收利息	6.4.7.5	2,302.10	1,367.91
应收股利		922,906.31	911.25
应收申购款		33,574.68	52,030.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		160,796,813.82	145,635,512.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 06 月 30 日	上年度末 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		-	-

应付证券清算款		3.77	6.15
应付赎回款		625,494.77	226,474.11
应付管理人报酬		201,632.68	202,586.40
应付托管费		37,806.13	37,984.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	13,253.40	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	322,104.80	360,746.43
负债合计		1,200,295.55	827,798.05
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	163,050,830.21	168,135,311.74
未分配利润	6.4.7.10	-3,454,311.94	-23,327,597.68
所有者权益合计		159,596,518.27	144,807,714.06
负债和所有者权益总计		160,796,813.82	145,635,512.11

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.979 元，基金份额总额 163,050,830.21 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富香港优势精选混合型证券投资基金

本报告期：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 2019年1月1日至2019 年6月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018 年06月30日
一、收入		21,654,717.12	-1,128,313.25
1. 利息收入		49,768.67	93,419.98
其中：存款利息收入	6.4.7.11	49,768.67	93,419.98
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,794,555.09	27,188,611.84
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,010,493.28	24,285,454.10
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.14.1	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-

衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	2,215,938.19	2,903,157.74
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	24,383,637.50	-29,703,556.09
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		1,072.53	1,157,673.16
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.19	14,793.51	135,537.86
减:二、费用		2,033,230.08	4,057,639.23
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,221,557.79	2,321,018.54
2.托管费	6.4.10.2.2	229,042.03	435,191.02
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	462,099.74	1,116,516.37
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		158.03	-
7.其他费用	6.4.7.21	120,372.49	184,913.30
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		19,621,487.04	-5,185,952.48

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富香港优势精选混合型证券投资基金

本报告期: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)	168,135,311.74	-23,327,597.68	144,807,714.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	19,621,487.04	19,621,487.04
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)	-5,084,481.53	251,798.70	-4,832,682.83
其中:1.基金申购款	10,773,365.05	-664,944.25	10,108,420.80
2.基金赎回款	-15,857,846.58	916,742.95	-14,941,103.63
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)	163,050,830.21	-3,454,311.94	159,596,518.27
项目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	250,064,012.27	34,832,904.77	284,896,917.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-5,185,952.48	-5,185,952.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-50,825,393.53	-4,823,041.40	-55,648,434.93
其中：1. 基金申购款	62,144,206.67	12,254,218.78	74,398,425.45
2. 基金赎回款	-112,969,600.20	-17,077,260.18	-130,046,860.38
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	199,238,618.74	24,823,910.89	224,062,529.63

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：

张暉

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

汇添富香港优势精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),原汇添富香港优势精选股票型证券投资基金,是由汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金转型而来。汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]1221号文《关于核准汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人汇添富基金管理有限公司(现汇添富基金管理股份有限公司)向社会公开发行募集,基金合同于2010年6月25日正式生效,首次设立募集规模为522,636,079.14份基金份额。本基金为契约型开放式,存

续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)。2014年1月8日，汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论通过了关于修改基金名称及投资细节的议案。在基金管理人向中国证监会履行相应备案手续，并经中国证监会书面确认后，基金份额持有人大会决议生效。2014年1月17日，中国证监会基金部函[2014]23号文《关于汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》书面确认后，原《汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金基金合同》失效，《汇添富香港优势精选股票型证券投资基金基金合同》生效，“汇添富亚洲澳洲成熟市场(除日本外)优势精选股票型证券投资基金”更名为“汇添富香港优势精选股票型证券投资基金”，同时基金投资目标、投资范围等投资细节相应调整。根据中国证券监督管理委员会于2014年8月8日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，汇添富基金管理股份有限公司决定自2015年8月5日起将本基金变更为混合基金，并相应修改本基金的《基金合同》。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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、会计估计和最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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。

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

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

6.4.6.1 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 06 月 30 日
活期存款	20,467,072.77
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：	20,467,072.77

注：本基金于 2019 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 8,564,208.62 元（折合人民币 7,533,591.75 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 06 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	128,759,510.67	137,983,731.47	9,224,220.80
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		128,759,510.67	137,983,731.47	9,224,220.80

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	2,302.10
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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借利息	-
其他	-
合计	2,302.10

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06月30日
交易所市场应付交易费用	13,253.40
银行间市场应付交易费用	-
合计	13,253.40

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,820.31
应付审计费	29,752.78
应付信息披露费	290,531.71
合计	322,104.80

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	168,135,311.74	168,135,311.74
本期申购	10,773,365.05	10,773,365.05
本期赎回（以“-”号填列）	-15,857,846.58	-15,857,846.58
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	163,050,830.21	163,050,830.21

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	14,172,489.88	-37,500,087.56	-23,327,597.68
本期利润	-4,762,150.46	24,383,637.50	19,621,487.04
本期基金份额交易产生的变动数	-197,506.14	449,304.84	251,798.70
其中：基金申购款	388,818.07	-1,053,762.32	-664,944.25
基金赎回款	-586,324.21	1,503,067.16	916,742.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,212,833.28	-12,667,145.22	-3,454,311.94

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	48,431.77
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,157.32

其他	179.58
合计	49,768.67

注：表中“其他”为直销申购款利息收入和保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	146,558,791.91
减：卖出股票成本总额	151,569,285.19
买卖股票差价收入	-5,010,493.28

6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,215,938.19
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,215,938.19

6.4.7.18 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	24,383,637.50
——股票投资	24,383,637.50
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值 税	-
合计	24,383,637.50

6.4.7.19 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	14,793.51
其他	-
合计	14,793.51

6.4.7.20 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	462,099.74
银行间市场交易费用	-
合计	462,099.74

6.4.7.21 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	29,752.78
信息披露费	90,531.71
银行汇划费用	88.00
合计	120,372.49

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
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
布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brother Harriman & Co.）（“布朗兄弟”）	基金境外托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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01月01日至2018年06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	41,238,129.03	14.09%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

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	32,990.82	23.67	13,253.40	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06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	-	-	-	-

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01月01日至2018 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,221,557.79	2,321,018.54
其中：支付销售机构的客户维护费	90,961.71	130,082.27

注：基金管理费按前一日基金资产净值的1.60%年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 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01月01日至2018年 06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	229,042.03	435,191.02

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日

等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年01月01日至2018年06月30日
期初持有的基金份额	40,017,937.50	40,017,937.50
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	40,017,937.50	40,017,937.50
期末持有的基金份额 占基金总份额比例(%)	24.54	20.09

注：本公司分别于2010年5月25日、2010年6月23日运用固有资金25,000,000.00元、15,000,000.00元认购本基金，总计认购基金份额40,017,937.50份（含募集期利息结转的份额），认购费用2,000.00元，符合招募说明书规定的认购费率。本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年01月01日至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	12,848,010.80	48,431.77	15,568,233.98	82,715.96
布朗兄弟哈里曼银行	7,619,061.97	-	26,463,335.58	-

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截止 2019 年 6 月 30 日，本基金合计持有中国森林（00930.HK）624,000 股。于 2017 年 2 月 22 日，中国森林（00930.HK）发布公告，香港联合交易所有限公司宣布，自 2017 年 2 月 24 日上午 9 时起，该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。为维护基金持有人利益，根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》的规定，依据中国森林控股有限公司公开披露的信息，汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人协商一致，将汇添富香港优势精选混合型证券投资基金所持有中国森林（00930.HK）按每股 0.00 港元估值。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。此外，基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本报告期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为部分银行存款及部分应收申购款。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	12,848,010.80	-	-	-	-	7,619,061.97	20,467,072.77
备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	137,983,731.47	137,983,731.47
应收股利	-	-	-	-	-	922,906.31	922,906.31
应收利息	-	-	-	-	-	2,302.10	2,302.10
应收申购款	3,056.35	-	-	-	-	30,518.33	33,574.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,387,226.49	1,387,226.49
应收买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	12,851,067.15	-	-	-	-	147,945,746.67	160,796,813.82
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	625,494.77	625,494.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	201,632.68	201,632.68
应付托管	-	-	-	-	-	37,806.13	37,806.13

费							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3.77	3.77
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	13,253.40	13,253.40
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	322,104.80	322,104.80
负债总计	-	-	-	-	-	1,200,295.55	1,200,295.55
利率敏感度缺口	12,851,067.15	-	-	-	-	-146,745,451.12	159,596,518.27
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							
银行存款	6,884,861.16	-	-	-	-	19,661,767.44	26,546,628.60
备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-119,034,573.84	119,034,573.84
应收股利	-	-	-	-	-	911.25	911.25
应收利息	-	-	-	-	-	1,367.91	1,367.91
应收申购款	-	-	-	-	-	52,030.51	52,030.51
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,884,861.16	-	-	-	-	-138,750,650.95	145,635,512.11
负债							
应付赎回	-	-	-	-	-	226,474.11	226,474.11

款							
应付管理人报酬		-	-	-	-	202,586.40	202,586.40
应付托管费		-	-	-	-	37,984.96	37,984.96
应付证券清算款		-	-	-	-	6.15	6.15
卖出回购金融资产款		-	-	-	-	-	-
应付销售服务费		-	-	-	-	-	-
应付交易费用		-	-	-	-	-	-
应交税费		-	-	-	-	-	-
应付利息		-	-	-	-	-	-
应付利润		-	-	-	-	-	-
其他负债		-	-	-	-	360,746.43	360,746.43
负债总计		-	-	-	-	827,798.05	827,798.05
利率敏感度缺口	6,884,861.16	-	-	-	-	-137,922,852.90	144,807,714.06

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末及上年度末计息资产仅包括部分银行存款及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日

	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	7,533,591.75	-	7,533,591.75
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	137,983,731.47	-	137,983,731.47
应收股利	-	676,285.67	-	676,285.67
应收利息	-	0.08	-	0.08
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	1,387,226.49	-	1,387,226.49
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	147,580,835.46	-	147,580,835.46
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	147,580,835.46	-	147,580,835.46
	上年度末			
	2018年12月31日			
项目	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	19,576,160.16	-	19,576,160.16
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	119,034,573.84	-	119,034,573.84
应收股利	-	911.25	-	911.25

应收利息	-	0.09	-	0.09
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	138,611,645.34	-	138,611,645.34
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	138,611,645.34	-	138,611,645.34

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 (2019年06月30日)	上年度末 (2018年12月31日)
	港币相对人民币升值5%	7,379,041.77	6,930,582.27
港币相对人民币贬值5%	-7,379,041.77	-6,930,582.27	

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年06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	137,983,731.47	86.46	119,034,573.84	82.20
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	137,983,731.47	86.46	119,034,573.84	82.20

注：本基金投资于股票的基金资产占基金资产总值的比例为 60%-95%；其余基金资产投资于固定收益产品、基金、货币市场工具以及相关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具，其占基金资产总值的比例为 5%-40%，其中基金持有的现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年06月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	MSCI 中华指数上涨 5%	8,200,297.28	7,565,909.55
	MSCI 中华指数下跌 5%	-8,200,297.28	-7,565,909.55

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	137,983,731.47	85.81
	其中：普通股	130,487,093.02	81.15
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	7,496,638.45	4.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,467,072.77	12.73
8	其他各项资产	2,346,009.58	1.46
9	合计	160,796,813.82	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 17,186,849.86 元，占期末净值比例 10.77%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
香港	137,983,731.47	86.46
合计	137,983,731.47	86.46

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
10 能源	-	-

15 原材料	8,752,924.88	5.48
20 工业	104,978.62	0.07
25 非必需消费品	29,100,481.08	18.23
30 必需消费品	1,490,825.78	0.93
35 医疗保健	11,177,267.84	7.00
40 金融	42,234,732.92	26.46
45 信息技术	11,222,280.04	7.03
50 电信服务	2,931,906.78	1.84
55 公用事业	7,351,688.07	4.61
60 房地产	23,616,645.46	14.80
合计	137,983,731.47	86.46

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港交易所	香港	117,500.00	8,708,084.21	5.46
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港交易所	香港	25,700.00	7,971,320.58	4.99
3	Times China Holdings Limited	时代中国控股有限公司	1233 HK	香港交易所	香港	569,000.00	7,828,235.09	4.91
4	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港交易所	香港	93,000.00	7,673,626.04	4.81
5	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港交易所	香港	1,280,000.00	7,577,743.10	4.75
6	Anhui Conch Cement Company Limited	安徽海螺水泥股份有限公司	914 HK	香港交易所	香港	173,000.00	7,449,268.76	4.67

				所				
7	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行股份有限公司	3968 HK	香港 联合 交易 所	香港	211,000.00	7,229,441.73	4.53
8	Fortune Real Estate Investment Trust	置富产业信托	778 HK	香港 联合 交易 所	香港	730,000.00	6,896,710.33	4.32
9	Li Ning Co. Ltd.	李宁有限公司	2331 HK	香港 联合 交易 所	香港	402,000.00	6,513,741.55	4.08
10	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	药明生物技术有限公司	2269 HK	香港 联合 交易 所	香港	101,000.00	6,232,523.05	3.91
11	Fuyao Glass Industry Group Co.,Ltd.	福耀玻璃工业集团股份有限公司	3606 HK	香港 联合 交易 所	香港	290,000.00	6,186,208.95	3.88
12	Shanghai Junshi Biosciences Co.,Ltd.	上海君实生物医药科技股份有限公司	1877 HK	香港 联合 交易 所	香港	188,000.00	4,944,744.79	3.10
13	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	香港交易及结算所有限公司	388 HK	香港 联合 交易 所	香港	20,000.00	4,852,204.56	3.04
14	Sands China Ltd.	金沙中国有限公司	1928 HK	香港 联合 交易 所	香港	122,000.00	4,008,346.72	2.51
15	China Maple Leaf Educational Systems Limited	中国枫叶教育集团有限公司	1317 HK	香港 联合 交易 所	香港	1,408,000.00	3,827,154.36	2.40
16	Henderson Land Development Co. Ltd.	恒基兆业地产有限公司	12 HK	香港 联合 交易 所	香港	90,200.00	3,415,816.54	2.14
17	Sun Hung Kai Properties Ltd.	新鸿基地产发展有限公司	16 HK	香港 联合 交易 所	香港	28,000.00	3,263,538.60	2.04

18	Inspur International Limited	浪潮国际有限公司	596 HK	香港交易所	香港	970,000.00	3,250,959.46	2.04
19	Galaxy Entertainment Group Limited	银河娱乐集团有限公司	27 HK	香港交易所	香港	67,000.00	3,103,044.63	1.94
20	Hang Seng Bank Ltd.	恒生银行有限公司	11 HK	香港交易所	香港	18,000.00	3,079,689.66	1.93
21	Beijing Enterprises Holdings Ltd.	北京控股有限公司	392 HK	香港交易所	香港	87,000.00	3,038,257.67	1.90
22	China Communications Services Corporation Limited	中国通信服务股份有限公司	552 HK	香港交易所	香港	550,000.00	2,931,906.78	1.84
23	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.	香港中华煤气有限公司	3 HK	香港交易所	香港	176,000.00	2,681,485.17	1.68
24	Lifestyle China Group Limited	利福中国集团有限公司	2136 HK	香港交易所	香港	900,000.00	2,026,736.64	1.27
25	Guangzhou Automobile Group Co., Ltd.	广州汽车集团股份有限公司	2238 HK	香港交易所	香港	260,000.00	1,907,454.74	1.20
26	Guangdong Investment Ltd.	粤海投资有限公司	270 HK	香港交易所	香港	120,000.00	1,631,945.23	1.02
27	New World Development Co. Ltd.	新世界发展有限公司	17 HK	香港交易所	香港	150,000.00	1,612,416.78	1.01
28	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	2601 HK	香港交易所	香港	60,000.00	1,612,416.78	1.01

29	Geely Automobile Holdings Limited	吉利汽车控股有限公司	175 HK	香港交易所	香港	130,000.00	1,527,793.49	0.96
30	Agricultural Bank of China Limited	中国农业银行股份有限公司	1288 HK	香港交易所	香港	522,000.00	1,501,526.84	0.94
31	Hengan International Group Company Limited	恒安国际集团有限公司	1044 HK	香港交易所	香港	29,500.00	1,490,825.78	0.93
32	China Molybdenum Co., Ltd.	洛阳栾川钼业集团股份有限公司	3993 HK	香港交易所	香港	600,000.00	1,303,656.12	0.82
33	Prosperity Real Estate Investment Trust	泓富产业信托	808 HK	香港交易所	香港	200,000.00	599,928.12	0.38
34	Transport International Holdings Limited	载通国际控股有限公司	62 HK	香港交易所	香港	5,200.00	104,978.62	0.07
35	China Forestry Holdings Co., Limited	中国森林控股有限公司	930 HK	香港交易所	香港	624,000.00	-	-

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Fortune Real Estate Investment Trust	778 HK	8,064,161.82	5.57
2	Anhui Conch Cement Company Limited	914 HK	7,599,909.36	5.25
3	Times China Holdings Limited	1233 HK	7,590,193.18	5.24
4	Fuyao Glass Industry Group Co., Ltd.	3606 HK	7,418,668.79	5.12
5	Henderson Land Development Co. Ltd.	12 HK	6,043,826.08	4.17

6	China Maple Leaf Educational Systems Limited	1317 HK	5,949,212.31	4.11
7	New World Development Co. Ltd.	17 HK	5,687,281.58	3.93
8	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	5,575,247.01	3.85
9	Sun Hung Kai Properties Ltd.	16 HK	5,471,818.05	3.78
10	Sunac China Holdings Limited	1918 HK	5,455,810.09	3.77
11	Shanghai Junshi Biosciences Co.,Ltd.	1877 HK	4,943,616.19	3.41
12	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	4,721,174.49	3.26
13	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	4,679,254.08	3.23
14	Galaxy Entertainment Group Limited	27 HK	4,578,826.96	3.16
15	Guangzhou Automobile Group Co., Ltd.	2238 HK	4,240,188.45	2.93
16	MTR Corporation Ltd.	66 HK	4,170,246.85	2.88
17	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.	3 HK	4,123,867.19	2.85
18	China Mobile Limited	941 HK	3,987,425.71	2.75
19	Sands China Ltd.	1928 HK	3,905,584.69	2.70
20	China Molybdenum Co.,Ltd.	3993 HK	3,786,980.56	2.62
21	AIA Group Limited	1299 HK	3,684,898.33	2.54
22	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	3,482,188.45	2.40
23	Inspur International Limited	596 HK	3,476,097.45	2.40
24	China Communications Services Corporation Limited	552 HK	3,296,451.44	2.28
25	Beijing Enterprises Holdings Ltd.	392 HK	3,270,527.78	2.26
26	Weichai Power Co.,Ltd.	2338 HK	2,921,829.44	2.02

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

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	7,836,125.42	5.41

2	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	2319 HK	7,540,915.38	5.21
3	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	6,931,484.29	4.79
4	Tencent Holdings Ltd	700 HK	6,698,728.82	4.63
5	Sunac China Holdings Limited	1918 HK	6,614,567.16	4.57
6	China Jinmao Holdings Group Limited	817 HK	6,505,269.93	4.49
7	China Maple Leaf Educational Systems Limited	1317 HK	6,018,645.71	4.16
8	New World Development Co. Ltd.	17 HK	4,937,136.59	3.41
9	Agricultural Bank of China Limited	1288 HK	4,934,292.03	3.41
10	CSPC Pharmaceutical Group Limited	1093 HK	4,817,305.14	3.33
11	MTR Corporation Ltd.	66 HK	4,437,817.32	3.06
12	Huatai Securities Co., Ltd.	6886 HK	4,307,551.41	2.97
13	Weichai Power Co., Ltd.	2338 HK	4,213,473.62	2.91
14	China Mobile Limited	941 HK	4,026,792.43	2.78
15	CITIC Securities Company Limited	6030 HK	4,018,836.04	2.78
16	Petrochina Company Limited	857 HK	4,007,967.98	2.77
17	3SBio Inc.	1530 HK	3,747,823.07	2.59
18	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	3,743,567.41	2.59
19	Beijing Enterprises Water Group Limited	371 HK	3,692,846.44	2.55
20	Henderson Land Development Co. Ltd.	12 HK	3,374,924.05	2.33
21	China Taiping Insurance Holdings Company Limited	966 HK	3,338,731.86	2.31
22	Chinasoft International Ltd.	354 HK	3,142,335.47	2.17
23	Dali Foods Group Company Limited	3799 HK	3,123,414.08	2.16
24	PICC Property and Casualty Company Limited	2328 HK	3,036,201.13	2.10

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

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	146,134,805.10
卖出收入（成交）总额	146,560,228.34

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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

7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,387,226.49
3	应收股利	922,906.31
4	应收利息	2,302.10
5	应收申购款	33,574.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,346,009.58

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
4,619	35,300.03	108,316,552.08	66.43	54,734,278.13	33.57

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	16,162.70	0.01

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010年6月25日) 基金份额总额	522,636,079.14
本报告期期初基金份额总额	168,135,311.74
本报告期基金总申购份额	10,773,365.05
减：本报告期基金总赎回份额	15,857,846.58
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	163,050,830.21

注：总申购份额含红利再投份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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 (%)	
Credit Suisse	-	87,556,944.64	29.91	28,278.85	20.29	-
BERNSTEIN	-	68,993,938.86	23.57	20,780.02	14.91	-
Morgan Stanley	-	50,617,697.37	17.29	32,523.82	23.34	-
东方证券	2	41,238,129.03	14.09	32,990.82	23.67	-
China Merchant Security	-	22,649,771.80	7.74	18,119.82	13.00	-

JPMorgan Chase & Co.	-	21,638,551.74	7.39	6,662.40	4.78	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Group, Inc.	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Ltd	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation	-	-	-	-	-	-
BOC International Holdings Ltd	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Group Limited	-	-	-	-	-	-
ICBC INTERNATIONAL	-	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
BERNSTEIN	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

China Merchant Security	-	-	-	-	-	-	-	-
JPMorgan Chase & Co.	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Group, Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-
BOC International Holdings Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Group Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC INTERNATIONAL	-	-	-	-	-	-	-	-

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：

本基金本报告期末新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下 QDII 基金 2018 年年度资产净值的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-01-03
2	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
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大智慧基金为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-01-26
4	汇添富香港优势精选混合型证券投资基金更新招募说明书(2019 年第 1 号)	上证报, 公司网站	2019-03-01
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加民生证券为代销机构并参与费率优惠活动的公告	上证报, 公司网站	2019-03-09
6	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
7	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
8	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
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加广发银行为代销机构的公告	上证报, 公司网站	2019-04-26
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加西部证券为代销机构的公告	上证报, 公司网站	2019-06-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	40,017,937.50	-	-	40,017,937.50	24.54
	2	2019 年 4 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	33,196,516.06	-	-	33,196,516.06	20.36
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

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

2、巨额赎回的风险

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

3、基金规模较小导致的风险

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

4、基金净值大幅波动的风险

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

5、提前终止基金合同的风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金募集的文件；

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

3、《汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金托管协议》；

- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、《关于汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；
- 6、《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 7、《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 8、报告期内汇添富香港优势精选混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 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 08 月 29 日