

# 汇添富价值精选混合型证券投资基金 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：中国工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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
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 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	12
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 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
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 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
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 .....	38
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 .....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	41
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 .....	42
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 .....	42
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 .....	42

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 .....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.12 投资组合报告附注 .....	42
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
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 .....	43
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>43</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>48</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富价值精选混合型证券投资基金
基金简称	汇添富价值精选混合
基金主代码	519069
前端交易代码	519069
后端交易代码	519070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 1 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	4,759,854,929.80 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选价值相对低估的优质公司股票，在有效管理风险的前提下，追求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金采用灵活积极的资产配置和股票投资策略。在资产配置中，通过以宏观经济及宏观经济政策分析为核心的情景分析法来确定投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例，并结合对市场估值、市场资金、投资主体行为和市场信心影响等因素的综合判断进行灵活调整；在股票投资中，采取“自下而上”的策略，优选价值相对低估的优质公司股票构建投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得长期持续稳健的投资收益。本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
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 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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	307,502,996.23
本期利润	2,147,981,287.79
加权平均基金份额本期利润	0.4934
本期加权平均净值利润率	21.02%
本期基金份额净值增长率	24.87%
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	3,496,443,579.17
期末可供分配基金份额利润	0.7346
期末基金资产净值	11,671,878,914.32
期末基金份额净值	2.452
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	471.29%

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

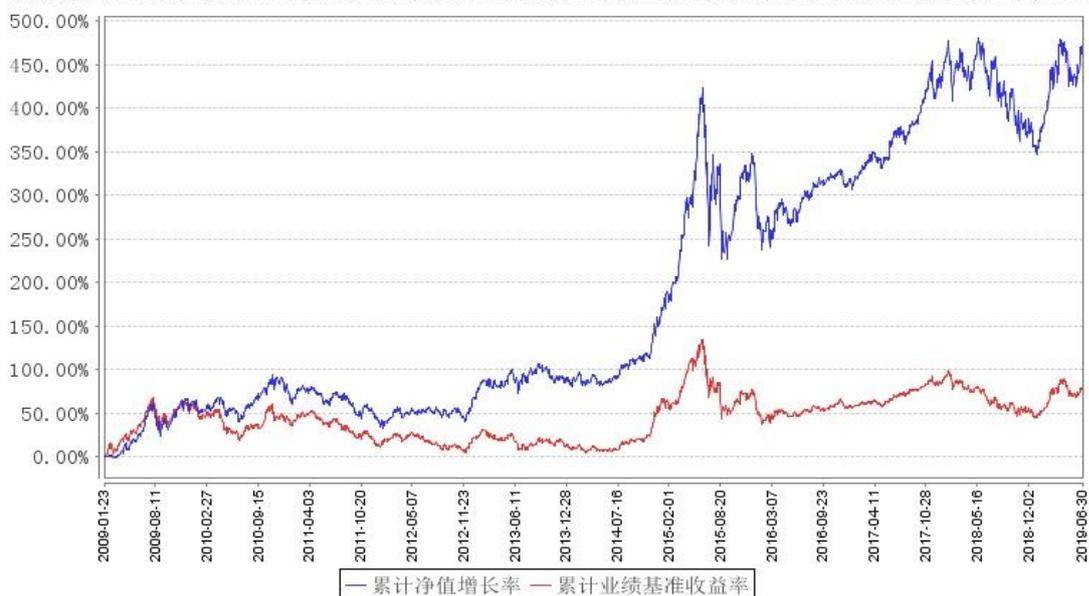
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	6.70%	1.19%	4.40%	0.93%	2.30%	0.26%
过去三个月	2.31%	1.45%	-0.82%	1.23%	3.13%	0.22%
过去六个月	24.87%	1.40%	22.06%	1.24%	2.81%	0.16%
过去一年	6.25%	1.42%	8.12%	1.22%	-1.87%	0.20%
过去三年	46.02%	1.10%	19.02%	0.89%	27.00%	0.21%
自基金合同 生效日起至 今	471.29%	1.42%	78.41%	1.23%	392.88 %	0.19%

### 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

汇添富价值精选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(2009年1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。

## § 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		
劳杰男	汇添富价值精选混合基金、添富3年封闭研究优选混合基金、添富红利增长混合基金的基金经理，研究总监。	2015年11月18日	-	9	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010年7月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任研究总监。2015年7月10日至2018年3月1日任汇添富国企创新股票基金的基金经理，2015年11月18日至今任汇添富价值精选混合基金的基金经理，2018

					年 2 月 13 日至 2019 年 2 月 22 日任添富沪港深大盘价值混合基金的基金经理，2019 年 1 月 31 日至今任添富 3 年封闭研究优选混合基金的基金经理，2019 年 4 月 26 日至今任添富红利增长混合基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

2019 年上半年，市场总体表现积极活跃，上证指数上涨 19.45%，深证成指上涨 26.78%，沪深 300 上涨 27.07%，创业板指上涨 20.87%，中小板指上涨 20.75%。分季度来看，一季度市场火爆，尤其是中小盘股票亢奋上涨，二季度在中美对抗的矛盾进一步激发、叠加国内流动性边际变化的背景下，市场有所调整，中小盘股票跌幅较大。

添富价值在上半年仍延续“行业相对均衡、个股适度集中、适时动态调整”的风格和思路。报告期内，主要围绕低估值高股息、消费升级、科技创新、先进制造、受益行业整合等逻辑脉络构建投资组合，注重行业和风格资产的相对均衡。个股层面，部分个股考虑到其阶段性的估值性价比吸引力不足，进行了兑现收益的卖出操作，大部分持有个股从中长期来看，仍有较好的收益空间，进行了一定的加仓。组合前十大部分个股有所变化与个股的涨跌有较大关系。

上半年，不足的地方在于总体股票仓位相对较低，一季度在 80%左右，二季度提升至 85%左右，总体资产配置贡献为负；另一方面，部分个股的选择在相应行业中表现较弱，尤其是在白酒股的投资中失分较多，过分担心其周期性的问题。好的地方在于继续坚守自身的投资理念和投资风格，坚持有所为有所不为，没有被一季度中小股票的亢奋上涨打乱节奏。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富价值精选混合基金份额净值为 2.452 元，本报告期基金份额净值增长率为 24.87%；同期业绩比较基准收益率为 22.06%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，海外经济可能同步进入下行周期。中国经济增长仍在逐步下台阶的过程中，但增长质量提高。中美经贸对抗的不确定仍悬在头顶，但市场也逐渐将其消化，冲击逐步减弱。另一方面，全球流动性宽松会是一个大的时代背景。

在这样的背景下，股票市场的走势大概率会是两级分化，呈现明显的价值投资特征。一方面，在经济下行、产业结构调整的过程中，优质企业面临的生存环境事实上是在变好的；另一方面，不论是海外还是国内，潜在愿意流入权益市场的资金源源不断，且更多是专业机构投资者的长线资金，优质股票的关注进一步得到增强。在当前位置，更应对中国的权益市场充满信心，尤其是

对于那些代表优秀公司的优质股票，从稍长期来看，几乎没有其它更好的投资选择可以替代。

从行业配置方向来看，未来消费升级仍将是趋势，且市场空间足够广阔，包括医药医疗在内的消费相关的行业仍是重点投资的行业方向。在经济转型之中，新兴产业同样也将获得趋势性的发展机会，包括信息技术、高端制造、先进材料、新能源等。另外，在无风险利率往下走、经济结构调整的大背景下，低估值高股息的资产以及受益于行业整合逻辑的资产，也是值得重点关注和投资的行业配置方向。

添富价值仍坚持自下而上优选个股集中，并相对均衡配置资产，不论是行业还是风格。在时机选择上，添富价值仍坚持不做频繁的时机选择，保持相对恒定的股票仓位。在中美对抗等一些风险相对没有那么大干扰的条件下，添富价值会逐步将股票仓位提升至 90%左右的水平。个股选择层面，仍重点关注向下有安全边际并有不错向上弹性的稳健类个股，这些个股往往有较好的商业模式和成长空间、竞争格局稳定、竞争优势明显、有好的公司治理和管理、估值也仍有吸引力；另外，阶段性重点投资低估值的价值股，其均值回归作为组合收益的重要补充。高成长性的股票仍积极关注研究，但对其的投资仍会谨慎，特别提防买入伪成长概念类个股。从添富价值的投资实践来看，相较于从 0 到 1 的高速成长，更偏好从 1 到 N 的稳健成长。

作为机构投资者，我们仍希望能够时刻保持良好且积极的心态，发挥自身在选股和风险控制方面的优势，通过深入研究并寻找具有良好盈利模式和竞争优势、优秀管理团队、合理估值水平的公司，并通过中长期持股来获取长期较好的回报。添富价值看淡短期排名，追求持续稳定增长的较高的年复合收益，尽管短期会有压力。再次感谢广大投资者的理解和信任！

#### 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

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，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 15%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金于 2019 年 6 月 19 日实施利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.800 元人民币。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富价值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，汇添富价值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价值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，汇添富价值精选混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 372,508,276.01 元。

#### 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价值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：汇添富价值精选混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,027,776,678.24	500,910,504.77
结算备付金		8,324,707.28	64,517,896.98
存出保证金		2,155,455.15	2,028,843.67
交易性金融资产	6.4.7.2	10,664,848,894.94	7,119,893,435.07
其中：股票投资		9,864,257,894.94	6,217,326,435.07
基金投资		-	-
债券投资		800,591,000.00	902,567,000.00
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	-	699,247,888.87
应收证券清算款		-	9,260,188.29
应收利息	6.4.7.5	23,710,561.14	14,807,536.30
应收股利		-	-
应收申购款		16,746,915.45	5,956,752.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		11,743,563,212.20	8,416,623,046.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		30,556,670.27	5,107,101.22
应付赎回款		19,247,646.51	2,124,645.37
应付管理人报酬		13,840,897.32	11,520,476.07
应付托管费		2,306,816.21	1,920,079.34
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	5,339,508.48	2,822,897.37
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	392,759.09	396,918.86
负债合计		71,684,297.88	23,892,118.23
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	4,759,854,929.80	4,132,363,232.37
未分配利润	6.4.7.10	6,912,023,984.52	4,260,367,696.24
所有者权益合计		11,671,878,914.32	8,392,730,928.61
负债和所有者权益总计		11,743,563,212.20	8,416,623,046.84

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.452 元，基金份额总额 4,759,854,929.80 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富价值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 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		2,253,207,121.99	57,057,219.47
1. 利息收入		18,150,575.23	10,520,340.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,209,504.58	2,239,019.41
债券利息收入		13,472,838.87	5,228,921.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,468,231.78	3,052,399.07
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		389,020,566.46	228,893,258.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	275,687,652.22	174,061,609.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	339,475.25	2,027,679.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	112,993,438.99	52,803,969.60
3. 公允价值变动收益（损失	6.4.7.17	1,840,478,291.56	-183,854,770.10

以“-”号填列)			
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	5,557,688.74	1,498,390.58
减: 二、费用		105,225,834.20	69,935,951.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	75,785,108.54	49,865,208.72
2. 托管费	6.4.10.2.2	12,630,851.42	8,310,868.12
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	16,653,782.67	11,542,550.26
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.99	8.81
7. 其他费用	6.4.7.20	156,090.58	217,315.43
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,147,981,287.79	-12,878,731.87

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 汇添富价值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)	4,132,363,232.37	4,260,367,696.24	8,392,730,928.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,147,981,287.79	2,147,981,287.79
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)	627,491,697.43	876,183,276.50	1,503,674,973.93
其中: 1. 基金申购款	2,477,166,166.24	3,488,430,908.32	5,965,597,074.56
2. 基金赎回款	-1,849,674,468.81	-2,612,247,631.82	-4,461,922,100.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-372,508,276.01	-372,508,276.01

净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	4,759,854,929.80	6,912,023,984.52	11,671,878,914.32
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）	2,157,498,326.38	3,089,318,173.81	5,246,816,500.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,878,731.87	-12,878,731.87
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）	1,332,781,487.08	2,016,071,744.70	3,348,853,231.78
其中：1. 基金申购款	1,830,531,306.52	2,776,308,093.87	4,606,839,400.39
2. 基金赎回款	-497,749,819.44	-760,236,349.17	-1,257,986,168.61
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）	-	-250,212,757.91	-250,212,757.91
五、期末所有者权益（基金净值）	3,490,279,813.46	4,842,298,428.73	8,332,578,242.19

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

汇添富价值精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），原汇添富价值精选股票型证券投资基金，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[2008]1317 号文

《关于核准汇添富价值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 2009 年 1 月 23 日正式生效，首次设立募集规模为 1,512,522,680.68 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。

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》。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金坚持长期价值投资的理念，采用深入的“自下而上”的公司基本面分析方法，精选价值相对低估的优质公司进行投资布局，通过科学的组合管理，实现投资目标。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

#### 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发展费附加的单位外）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	1,027,776,678.24
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	1,027,776,678.24

##### 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	8,698,180,174.37	9,864,257,894.94	1,166,077,720.57	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	801,294,290.00	800,591,000.00	-703,290.00
	合计	801,294,290.00	800,591,000.00	-703,290.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	9,499,474,464.37	10,664,848,894.94	1,165,374,430.57	

##### 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	175,149.52
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	3,371.49
应收债券利息	23,531,167.13
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	873.00
合计	23,710,561.14

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	5,339,508.48
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,339,508.48

#### 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	57,596.40
应付信息披露费	290,531.71

应付审计费	44,630.98
合计	392,759.09

#### 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	4,132,363,232.37	4,132,363,232.37
本期申购	2,477,166,166.24	2,477,166,166.24
本期赎回（以“-”号填列）	-1,849,674,468.81	-1,849,674,468.81
- 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	4,759,854,929.80	4,759,854,929.80

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	3,086,315,730.96	1,174,051,965.28	4,260,367,696.24
本期利润	307,502,996.23	1,840,478,291.56	2,147,981,287.79
本期基金份额交易产生的变动数	475,133,127.99	401,050,148.51	876,183,276.50
其中：基金申购款	1,883,759,316.73	1,604,671,591.59	3,488,430,908.32
基金赎回款	-1,408,626,188.74	-1,203,621,443.08	-2,612,247,631.82
本期已分配利润	-372,508,276.01	-	-372,508,276.01
本期末	3,496,443,579.17	3,415,580,405.35	6,912,023,984.52

#### 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	2,978,483.10
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	138,738.90	
其他	92,282.58	
合计	3,209,504.58	

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	5,054,642,734.02
减：卖出股票成本总额	4,778,955,081.80
买卖股票差价收入	275,687,652.22

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	339,475.25
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	339,475.25

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	105,470,586.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	101,030,800.00
减：应收利息总额	4,100,310.85
买卖债券差价收入	339,475.25

##### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本期未投资衍生工具。

## 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	112,993,438.99
基金投资产生的股利收益	-
合计	112,993,438.99

## 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	1,840,478,291.56
股票投资	1,842,531,491.56
债券投资	-2,053,200.00
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	1,840,478,291.56

## 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	5,557,688.74
合计	5,557,688.74

## 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	16,653,782.67
银行间市场交易费用	-
合计	16,653,782.67

## 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	2,327.89
合计	156,090.58

#### 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

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	1,652,933,642.54	14.21	244,885,075.96	2.91

### 6.4.10.1.2 债券交易

注:本基金本报告期和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

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	-	-	400,000,000.00	3.23

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 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	1,527,951.69	14.46	1,047,280.03	19.61
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	226,296.27	2.93	85,711.60	2.28

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	75,785,108.54	49,865,208.72
其中：支付销售机构的客户维护费	10,181,837.40	5,935,819.16

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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 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、公休等，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	12,630,851.42	8,310,868.12

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

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 2 个工作日内从基金资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自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（2009年1月23日）持有的基金份额		-		-
报告期初持有的基金份额		8,103,322.53		8,103,322.53
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		8,103,322.53		8,103,322.53
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例		0.17%		0.23%

注：1、本基金于2009年1月23日成立。本公司于2015年7月6日用自有资金20,000,000.00元申购本基金份额8,103,322.53份，申购费用1,000.00元。符合招募说明书规定的申购费率。

2、本报告期内基金管理人及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

##### 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
中国工商银行股份有限公司	1,027,776,678.24	2,978,483.10	471,884,853.03	2,033,802.35

##### 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参与关联方承销证券。

### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2019 年 6 月 19 日	-	2019 年 6 月 19 日	0.800	219,942,276.34	152,565,999.67	372,508,276.01	-
合计	-	-	-	0.800	219,942,276.34	152,565,999.67	372,508,276.01	-

### 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
002044	美年健康	2017 年 11 月 22 日	2019 年 11 月 25 日	非公开发行流通受限	17.61	11.78	1,448,041	25,500,002.01	17,057,922.98	-
002044	美年健康	2018 年 6 月 11 日	2019 年 11 月 25 日	非公开发行流通受限-转增	-	11.78	289,608	-	3,411,582.24	-
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	-

注:根据美年健康 2018 年 6 月 4 日发布的《2017 年年度权益分派实施公告》，美年健康以公司现有总股本 2,601,305,797 股为基数，向全体股东每 10 股派 0.50 元人民币现金，同时，以资本公积向全体股东每 10 股转增 2 股，除权除息日为 2018 年 6 月 11 日。本基金所持有的美年健康共获得转增股 2,199,996 股，其中流通受限 289,608 股。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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, 本基金无因从事证券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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.2.1 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	800,591,000.00	-
合计	800,591,000.00	-

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债和超短期融资券。本基金上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、债券投资、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产及部分应收申购款等；生息负债主要为卖出回购金融资产款。

##### 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	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
----------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

30 日							
资产							
银行存款	1,027,776, 678.24	-	-	-	-	-	1,027,776,67 8.24
结算 备付 金	8,324,707. 28	-	-	-	-	-	-8,324,707.28
存出 保证 金	2,155,455. 15	-	-	-	-	-	-2,155,455.15
交易 性金 融资 产	530,159,00 0.00	270,432,000 .00	-	-	-	9,864,257,8 94.94	10,664,848,8 94.94
应收 利息	-	-	-	-	-	23,710,561. 14	23,710,561.1 4
应收 申购 款	1,490,476. 89	-	-	-	-	15,256,438. 56	16,746,915.4 5
资产 总计	1,569,906, 317.56	270,432,000 .00	-	-	-	9,903,224,8 94.64	11,743,563,2 12.20
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	19,247,646. 51	19,247,646.5 1
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	13,840,897. 32	13,840,897.3 2
应付 托管 费	-	-	-	-	-	2,306,816.2 1	2,306,816.21
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	30,556,670. 27	30,556,670.2 7
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	5,339,508.4 8	5,339,508.48
其他 负债	-	-	-	-	-	392,759.09	392,759.09
负债 总计	-	-	-	-	-	71,684,297. 88	71,684,297.8 8

利率敏感 度缺口	1,569,906, 317.56	270,432,000 .00	-	-	-	9,831,540,5 96.76	11,671,878,9 14.32
上 年 度 末 201 8 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	500,910,50 4.77	-	-	-	-	-	500,910,504. 77
结算 备付 金	64,517,896 .98	-	-	-	-	-	64,517,896.9 8
存出 保证 金	2,028,843. 67	-	-	-	-	-	-2,028,843.67
交易 性金 融资 产	-	100,250,000 .00	802,317,00 0.00	-	-	6,217,326,4 35.07	7,119,893,43 5.07
买入 返售 金融 资产	699,247,88 8.87	-	-	-	-	-	699,247,888. 87
应收 利息	-	-	-	-	-	14,807,536. 30	14,807,536.3 0
应收 申购 款	1,256,014. 04	-	-	-	-	4,700,738.8 5	5,956,752.89
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	9,260,188.2 9	9,260,188.29
资产 总计	1,267,961, 148.33	100,250,000 .00	802,317,00 0.00	-	-	6,246,094,8 98.51	8,416,623,04 6.84
负债							
应付	-	-	-	-	-	-2,124,645.3	2,124,645.37

赎回款						7	
应付管理人报酬						11,520,476.07	11,520,476.07
应付托管费						1,920,079.34	1,920,079.34
应付证券清算款						5,107,101.22	5,107,101.22
应付交易费用						2,822,897.37	2,822,897.37
其他负债						396,918.86	396,918.86
负债总计						23,892,118.23	23,892,118.23
利率敏感度缺口	1,267,961,148.33	100,250,000.00	802,317,000.00			6,222,202,780.28	8,392,730,928.61

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；	
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；	
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；	
	4. 银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产的利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响。	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

分析	动	本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	基准利率增加 25 个基点	-192,798.00	-1,202,378.80
基准利率减少 25 个基点	192,970.08	1,205,843.44	

#### 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	9,864,257,894.94	84.51	6,217,326,435.07	74.08
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	800,591,000.00	6.86	902,567,000.00	10.75
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	10,664,848,894.94	91.37	7,119,893,435.07	84.83
----	-------------------	-------	------------------	-------

注：本基金股票投资占基金资产的比例为 60-95%，现金、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5-40%，其中，基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及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%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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表所示。

#### 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6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	沪深 300 指数上涨 5%	517,416,166.48	389,849,167.69
	沪深 300 指数下跌 5%	-517,416,166.48	-389,849,167.69

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	9,864,257,894.94	84.00

	其中：股票	9,864,257,894.94	84.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	800,591,000.00	6.82
	其中：债券	800,591,000.00	6.82
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,036,101,385.52	8.82
8	其他各项资产	42,612,931.74	0.36
9	合计	11,743,563,212.20	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	71,722,115.74	0.61
B	采矿业	363,431.25	0.00
C	制造业	4,499,157,079.16	38.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	235,750,115.00	2.02
F	批发和零售业	408,400,071.47	3.50
G	交通运输、仓储和邮政业	377,012,513.40	3.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	177,648,366.52	1.52
J	金融业	2,933,213,238.54	25.13
K	房地产业	412,921,200.44	3.54
L	租赁和商务服务业	407,741,822.27	3.49
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	340,304,834.55	2.92
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	9,864,257,894.94	84.51

### 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	10,000,055	886,104,873.55	7.59
2	600036	招商银行	20,000,047	719,601,691.06	6.17
3	601166	兴业银行	30,000,057	548,701,042.53	4.70
4	000333	美的集团	10,000,050	518,602,593.00	4.44
5	600436	片仔癀	4,000,044	460,805,068.80	3.95
6	002475	立讯精密	17,000,096	421,432,379.84	3.61
7	601933	永辉超市	40,000,007	408,400,071.47	3.50
8	600009	上海机场	4,500,030	377,012,513.40	3.23
9	600426	华鲁恒升	25,000,091	371,501,352.26	3.18
10	300408	三环集团	19,000,033	369,550,641.85	3.17
11	002142	宁波银行	15,000,044	363,601,066.56	3.12
12	600309	万华化学	8,400,078	359,439,337.62	3.08
13	601888	中国国旅	4,000,097	354,608,599.05	3.04
14	300003	乐普医疗	14,999,965	345,299,194.30	2.96
15	002415	海康威视	12,500,033	344,750,910.14	2.95
16	600519	贵州茅台	330,045	324,764,280.00	2.78
17	000961	中南建设	30,000,062	259,800,536.92	2.23
18	601668	中国建筑	41,000,020	235,750,115.00	2.02
19	600887	伊利股份	7,000,056	233,871,870.96	2.00
20	600030	中信证券	9,000,002	214,290,047.62	1.84
21	601688	华泰证券	9,000,029	200,880,647.28	1.72
22	600298	安琪酵母	6,000,090	189,782,846.70	1.63
23	002044	美年健康	15,000,083	185,454,184.18	1.59
24	002410	广联达	5,400,084	177,608,762.76	1.52
25	600176	中国巨石	17,000,065	162,010,619.45	1.39
26	603288	海天味业	1,500,044	157,504,620.00	1.35
27	300015	爱尔眼科	5,000,021	154,850,650.37	1.33
28	600048	保利地产	12,000,052	153,120,663.52	1.31
29	002466	天齐锂业	3,000,027	75,840,682.56	0.65
30	300498	温氏股份	2,000,059	71,722,115.74	0.61
31	600585	海螺水泥	1,500,000	62,250,000.00	0.53
32	000786	北新建材	3,000,000	54,390,000.00	0.47
33	300662	科锐国际	1,500,091	53,133,223.22	0.46

34	000858	五 粮 液	400,032	47,183,774.40	0.40
35	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.00
36	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
37	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
38	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
39	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
40	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
41	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
42	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	394,449,757.02	4.70
2	300003	乐普医疗	351,602,873.85	4.19
3	601166	兴业银行	299,838,196.51	3.57
4	600519	贵州茅台	297,150,803.34	3.54
5	000961	中南建设	270,639,900.43	3.22
6	601668	中国建筑	263,109,010.58	3.13
7	600309	万华化学	258,798,839.09	3.08
8	000333	美的集团	248,149,825.73	2.96
9	000858	五 粮 液	238,906,409.70	2.85
10	600030	中信证券	230,236,865.49	2.74
11	600887	伊利股份	214,630,397.89	2.56
12	601688	华泰证券	214,093,399.92	2.55
13	600176	中国巨石	185,501,228.43	2.21
14	300498	温氏股份	175,548,189.56	2.09
15	002410	广联达	173,967,568.11	2.07
16	300015	爱尔眼科	173,109,702.80	2.06
17	600298	安琪酵母	167,120,548.14	1.99
18	300747	锐科激光	159,766,011.26	1.90
19	002916	深南电路	137,437,682.59	1.64
20	601186	中国铁建	136,201,156.45	1.62

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	601939	建设银行	510,663,768.58	6.08
2	600309	万华化学	351,880,595.26	4.19
3	603288	海天味业	309,341,538.84	3.69

4	600104	上汽集团	280,070,621.96	3.34
5	600030	中信证券	251,003,524.31	2.99
6	601186	中国铁建	236,464,491.67	2.82
7	601688	华泰证券	225,539,412.79	2.69
8	000858	五粮液	207,146,722.05	2.47
9	000002	万科A	206,713,462.64	2.46
10	002475	立讯精密	201,498,361.95	2.40
11	601933	永辉超市	154,447,180.10	1.84
12	002415	海康威视	142,922,885.96	1.70
13	300498	温氏股份	135,508,118.62	1.61
14	300747	锐科激光	135,469,162.99	1.61
15	002916	深南电路	133,623,155.68	1.59
16	600570	恒生电子	131,627,469.01	1.57
17	002352	顺丰控股	127,633,397.93	1.52
18	300408	三环集团	101,147,741.41	1.21
19	601211	国泰君安	95,751,125.69	1.14
20	600298	安琪酵母	93,647,518.57	1.12

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	6,583,355,050.11
卖出股票收入(成交)总额	5,054,642,734.02

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	800,591,000.00	6.86
	其中:政策性金融债	800,591,000.00	6.86
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	800,591,000.00	6.86

### 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	180209	18 国开 09	5,300,000	530,159,000.00	4.54
2	180312	18 进出 12	2,700,000	270,432,000.00	2.32

### 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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期未持有国债期货投资。

## 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	2,155,455.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,710,561.14
5	应收申购款	16,746,915.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	42,612,931.74
---	----	---------------

### 7.12.4 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。

### 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(%)
565,586	8,415.79	2,159,757,070.52	45.37	2,600,097,859.28	54.63

### 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	6,904,163.08	0.15

### 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年1月23日)基金份额总额	1,512,522,680.68
本报告期期初基金份额总额	4,132,363,232.37
本报告期基金总申购份额	2,477,166,166.24
减：本报告期基金总赎回份额	1,849,674,468.81
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	4,759,854,929.80

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	
东方证券	2	1,652,933,642.54	14.21%	1,527,951.69	14.46%	-
光大证券	2	1,537,675,758.52	13.21%	1,423,425.38	13.47%	-
华创证券	1	1,413,178,218.78	12.14%	1,287,829.26	12.19%	-
中信证券	2	1,108,293,490.47	9.52%	1,024,178.67	9.69%	-
海通证券	2	1,063,077,403.88	9.14%	985,045.36	9.32%	-

西藏东方财富	2	866,610,572.82	7.45%	629,655.50	5.96%	-
广发证券	2	790,198,412.38	6.79%	730,293.07	6.91%	-
国盛证券	2	685,273,881.87	5.89%	629,839.66	5.96%	-
天风证券	2	395,916,396.99	3.40%	364,343.03	3.45%	-
新时代证券	2	285,896,395.87	2.46%	265,113.54	2.51%	-
太平洋证券	2	271,184,130.21	2.33%	252,553.99	2.39%	-
国金证券	2	259,578,330.41	2.23%	241,585.70	2.29%	-
银河证券	1	228,648,463.74	1.97%	212,940.04	2.02%	-
国信证券	2	225,956,927.57	1.94%	206,209.45	1.95%	-
招商证券	2	225,745,984.34	1.94%	208,146.67	1.97%	-
中金公司	2	176,924,100.60	1.52%	161,230.94	1.53%	-
中投证券	2	149,844,316.11	1.29%	139,549.14	1.32%	-
民生证券	1	121,554,662.66	1.04%	113,204.66	1.07%	-
万联证券	1	106,787,223.48	0.92%	99,450.66	0.94%	-
汇丰前海证券	2	70,684,938.30	0.61%	64,415.19	0.61%	-
财富里昂证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	700,000,000.00	70.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	300,000,000.00	30.00%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	1,370,586.10	100.00%	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

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 3 个交易单元：汇丰前海证券（上交所单元和深交所单元）、光大证券（上交所单元）。退租 1 家证券公司的 2 个交易单元：中邮证券（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万得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	2019-01-11
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
5	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
6	汇添富价值精选混合型证券投资基金	中证报, 上交所, 公司网	2019-03-01

	更新招募说明书（2019 年第 1 号）	站	
7	汇添富价值精选混合型证券投资基金调整在招商银行的定期定额投资起点、最低赎回份额和最低账户持有份额的公告	中证报, 公司网站	2019-03-05
8	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
9	关于汇添富价值精选混合型证券投资基金增加包商银行行为代销机构的公告	中证报, 公司网站	2019-03-29
10	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
11	关于汇添富价值精选混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2019-06-13
12	汇添富价值精选混合型证券投资基金收益分配公告	中证报, 上交所, 公司网站	2019-06-17
13	关于汇添富价值精选混合型证券投资基金增加宏信证券为代销机构的公告	中证报, 公司网站	2019-06-22
14	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

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价值精选股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富价值精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富价值精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富价值精选混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 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](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2019 年 8 月 29 日