

# 汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合 型基金中基金（FOF）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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 4 月 29 日（基金合同生效日）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 .....	5
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>7</b>
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 .....	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 .....	9
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 .....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
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 .....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
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的真实、准确和完整发表意见 .....	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表 .....	12
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>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	36
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 .....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	37
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 .....	37
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 .....	37
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 .....	37

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 .....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	38
7.12 投资组合报告附注 .....	40
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
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 .....	41
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>41</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
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 .....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4 基金投资策略的改变 .....	42
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	42
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	42
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.9 其他重大事件 .....	45
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>46</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 .....	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	46
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>46</b>
12.1 备查文件目录 .....	46
12.2 存放地点 .....	47
12.3 查阅方式 .....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金 (FOF)
基金简称	汇添富养老 2040 五年持有混合 (FOF)
基金主代码	007059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 4 月 29 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	472,120,429.28 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金随着所设定目标日期的临近,逐步降低权益类资产的配置比例,增加非权益类资产的配置比例,采用成熟的资产配置策略,合理控制投资组合波动风险,追求养老资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用目标日期策略,即随着所设定目标日期 2040 年的临近,逐步降低权益类资产的配置比例,增加非权益类资产的配置比例。在严格控制投资组合下行风险的前提下确定大类资产配置比例,并通过全方位的定量和定性分析方法精选出优质基金组成投资组合,以期达到风险收益的优化平衡,实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×X+中债综合指数收益率×(1-X)(详见基金合同)
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金,其预期风险和收益水平高于债券型基金中基金和货币型基金中基金,低于股票型基金中基金。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	贺倩
	电子邮箱	021-28932888
客户服务电话	service@99fund.com	010-66060069
传真	400-888-9918	tgxxpl@abchina.com
注册地址	400-888-9918	95599
办公地址	021-28932998	010-68121816
邮政编码	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区 (东座) 6 楼 H686 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
法定代表人	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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
	200120	100031
	李文	周慕冰

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
----------------	--------

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 4 月 29 日(基金合同生效日) - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,888,471.49
本期利润	14,369,238.19
加权平均基金份额本期利润	0.0305
本期加权平均净值利润率	3.03%
本期基金份额净值增长率	3.04%
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	1,889,225.59
期末可供分配基金份额利润	0.0040
期末基金资产净值	486,493,300.35
期末基金份额净值	1.0304
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	3.04%

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。

4、本基金的《基金合同》生效日为 2019 年 4 月 29 日,至本报告期末未满一年,因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2019 年 6 月 30 日数据,特此说明。

### 3.2 基金净值表现

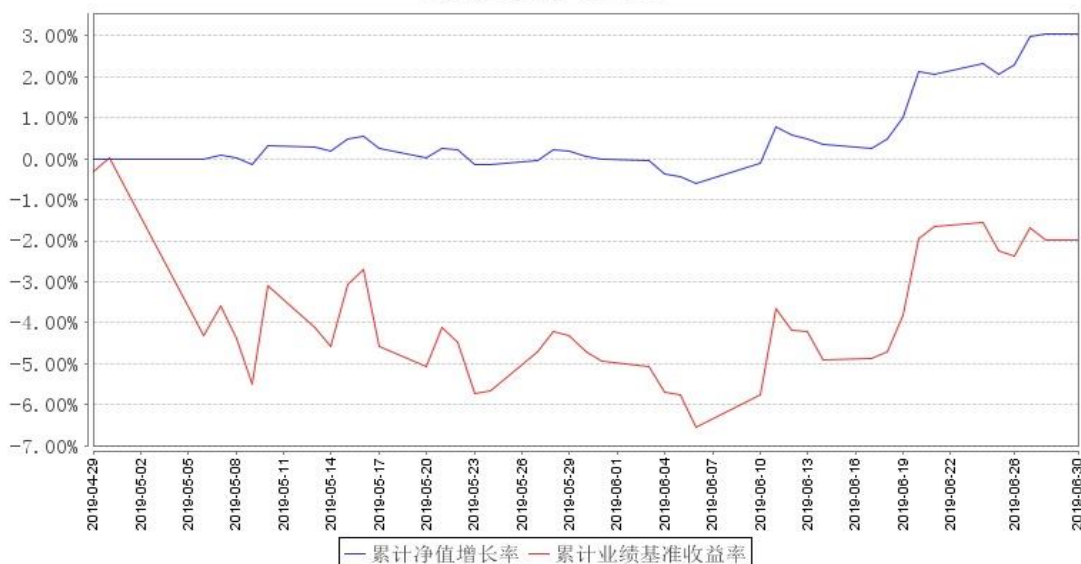
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	------	-------	--------	-----	-----

	增长率①	增长率标准 差②	准收益率③	收益率标准 差④		
过去一个月	3.06%	0.39%	3.10%	0.83%	-0.04%	-0.44%
自基金合同 生效日起至 今	3.04%	0.31%	-1.98%	1.14%	5.02%	-0.83%

### 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

汇添富养老2040五年持有混合 (FOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本《基金合同》生效之日为2019年4月29日,截至本报告期末,基金成立未满一年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2019年4月29日)起6个月,截止本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

## § 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、全国社保基金境外配售策略方案投资管理、基本养老保险基金投资管理、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		
蔡健林	汇添富养老 2030 三年持有混合 (FOF)、汇添富养老 2040 五年持有混合 (FOF)、汇添富养老 2050 五年持有混合 (FOF) 的基金经理	2019 年 4 月 29 日	-	9	国籍: 中国。学历: 上海交通大学硕士。相关业务资格: 证券投资基金业务资格。从业经历: 8 年 FOF 投资经验, 曾任太平洋资产管理有限责任公司高级投资经理, 2017 年 8 月加入汇添富基金管理有限公司, 2018 年 12 月 27 日至今任汇添富养老 2030 三年持有混合 (FOF) 的基金经理, 2019 年 4 月 29 日至今任汇添富养老 2040 五年持有混合 (FOF) 的基金经理, 2019 年 5 月 17 日至今任汇添富养老 2050 五年持有混合 (FOF) 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,沪深 300 涨幅 27%,创业板上涨 21%,中证转债指数上涨 13%,3-5 年 AAA 企业债上涨 2.5%。股票资产上涨主要在一季度,原因是全球流动性宽松,国内货币宽松叠加信用宽松,社融增速恢复,经济增速逐渐稳定回升;中美贸易战缓和减弱市场对于全球经济下滑的担忧,

大幅提升市场风险偏好；海外机构加大 A 股资产配置，带来边际增量资金。二季度货币政策微调和中美贸易战恶化，股票资产出现大幅回调；债券资产受益于流动性宽松，稳健增值；美联储结束加息进程，转向降息周期，美元债券收益率大幅下行。

我们遵循“策略风格相对均衡、精选优质价值基金、持仓适度集中、适时动态微调”的操作思路和风格。产品成立初期，我们稳步建仓，配置量化对冲和偏债混合型基金等类绝对收益属性的基金产品作为基础收益来源。5 月份，国内货币政策微调和宏观经济转弱，叠加中美贸易战情况恶化，股市出现大幅回调，我们坚定增持优质股票基金，取得较好收益。

总体来看，本基金以权益资产配置为主，类固收类资产配置为辅，争取获得长期、稳定、较高的投资收益；其中，股票基金持仓以长期稳定增值、风格特征清晰的价值型风格为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金 (FOF) 份额净值为 1.0304 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.04%；同期业绩比较基准收益率为-1.98%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济下行压力较大，利率进入下降周期比较确定，国内“货币政策强调适时适度调节”，维持宏观杠杆率稳定，降低实体企业融资成本，促进经济机构转型。严守“房住不炒”，财政加大投入有利于维持下半年经济稳定增长，守住经济大幅下行的系统性风险。金融供给侧改革，货币环境保持宽松，促进降低企业融资成本。债券绝对收益率不高，但是利率上行风险有限，仍旧具有配置价值。权益资产长期受益于居民财富配置需求，低利率环境有利于支撑 A 股估值水平，盈利稳定增长的龙头企业具有非常好的投资价值。

#### 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

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司 2019 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务

指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金 (FOF)

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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	99,523,730.98
结算备付金		5,175,252.56
存出保证金		3,885.13
交易性金融资产	6.4.7.2	381,613,998.59
其中：股票投资		-
基金投资		381,613,998.59
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		-
应收利息	6.4.7.5	333,548.24
应收股利		39,936.54
应收申购款		104,508.09
递延所得税资产		-

其他资产	6.4.7.6	177.20
资产总计		486,795,037.33
<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>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		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		216,408.35
应付托管费		44,519.12
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	-
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	40,809.51
负债合计		301,736.98
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	472,120,429.28
未分配利润	6.4.7.10	14,372,871.07
所有者权益合计		486,493,300.35
负债和所有者权益总计		486,795,037.33

注:报告截止日 2019 年 6 月 30 日, 基金份额净值 1.0304 元, 基金份额总额 472,120,429.28 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期：2019 年 4 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2019 年 4 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		15,020,553.32
1. 利息收入		663,890.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	498,955.83
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		164,934.21
其他利息收入		-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		1,875,575.83
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
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	-
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	1,875,575.83
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.18	12,480,766.70
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.19	320.75
减: 二、费用		651,315.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	495,984.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	93,946.30
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	12,981.40
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.21	48,402.98
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		14,369,238.19

注: 本基金合同于 2019 年 4 月 29 日生效, 无比较式的上年度可比期间, 因此利润表只列示 2019 年 4 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日数据, 特此说明。

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期: 2019 年 4 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 4 月 29 日（基金合同生效日）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）	471,716,422.66	-	471,716,422.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,369,238.19	14,369,238.19
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）	404,006.62	3,632.88	407,639.50
其中：1. 基金申购款	404,006.62	3,632.88	407,639.50
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	472,120,429.28	14,372,871.07	486,493,300.35

注：本基金合同于 2019 年 4 月 29 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益（基金净值）变动表只列示 2019 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日数据，特此说明。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

汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金（FOF）（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[2018]1668 号《关于准予汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》准予注册，由汇添富基



金管理股份有限公司于 2019 年 4 月 8 日至 2019 年 4 月 25 日止期间向社会公开募集, 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 (2019) 验字第 60466941\_B18 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 2019 年 4 月 29 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 471,612,238.41 元, 在募集期间产生的活期存款利息为人民币 104,184.25 元, 以上实收基金 (本息) 合计为人民币 471,716,422.66 元, 折合 471,716,422.66 份基金份额。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, 基金托管人为中国农业银行股份有限公司。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金 (以下简称 “证券投资基金”, 包含封闭式基金、开放式基金、上市开放式基金 (LOF) 和交易型开放式指数基金 (ETF)、QDII 基金、香港互认基金等)。为更好地实现投资目标, 本基金还可投资于股票 (包含中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、债券 (包含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券 (含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券 (含超短期融资券) 等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场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 (但须符合中国证监会的相关规定)。本基金随着所设定目标日期 2040 年的临近, 逐步降低权益类资产的配置比例, 增加非权益类资产的配置比例。采用成熟的资产配置策略, 合理控制投资组合波动风险, 追求养老资产的长期稳健增值。本基金业绩比较基准为: 中证 800 指数收益率 $\times$ X+中债综合指数收益率 $\times$ (1-X)

#### 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 重要会计政策和会计估计

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

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2019 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

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

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### （1）金融资产分类

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

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

###### （2）金融负债分类

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

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的基金和债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，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;

2、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;

3、每一基金份额享有同等分配权;

4、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 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	29,523,730.98
定期存款	70,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	70,000,000.00
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	99,523,730.98

##### 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	-	-	-
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	369,133,231.89	381,613,998.59	12,480,766.70
其他	-	-	-
合计	369,133,231.89	381,613,998.59	12,480,766.70

#### 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	7,408.61
应收定期存款利息	324,041.85
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,096.01
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	0.24
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.53
合计	333,548.24

注:“其他”为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

单位:人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
其他应收款	177.20
待摊费用	-
合计	177.20

#### 6.4.7.7 应付交易费用

注:本基金本报告期末无应付交易费用余额。

### 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	17,854.20
应付审计费	22,955.31
合计	40,809.51

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年4月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	471,716,422.66	471,716,422.66
本期申购	404,006.62	404,006.62
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 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	472,120,429.28	472,120,429.28

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）本基金合同于2019年4月29日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币471,612,238.41元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币104,184.25元，以上实收基金（本息）合计为人民币471,716,422.66元，折合471,716,422.66份基金份额。

### 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,888,471.49	12,480,766.70	14,369,238.19
本期基金份额交易产生的变动数	754.10	2,878.78	3,632.88
其中：基金申购款	754.10	2,878.78	3,632.88
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,889,225.59	12,483,645.48	14,372,871.07

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日

活期存款利息收入	168,847.18
定期存款利息收入	324,041.85
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,055.19
其他	11.61
合计	498,955.83

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

注:本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位:人民币元

项目	本期
	2019年4月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	500,570.62
减:卖出/赎回基金成本总额	500,570.62
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4月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	-
基金投资产生的股利收益	1,875,575.83
合计	1,875,575.83

#### 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4月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日
1.交易性金融资产	12,480,766.70

股票投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	12,480,766.70
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	12,480,766.70

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
基金赎回费收入	-
销售服务费返还	320.75
合计	320.75

#### 6.4.7.20 交易费用

项目	本期 2019年4月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	12,981.40
其中：申购费	12,000.00
赎回费	-
交易费	981.40
合计	12,981.40

#### 6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2019年4月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	417,614.95
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	76,743.89

注：：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金

的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 4 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	22,955.31
信息披露费	17,854.20
银行费用	7,193.47
其他	400.00
合计	48,402.98

注：其中“其他”为开户费。

#### 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
中国农业银行股份有限公司 (“农业银行”)	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

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

### 6.4.10.1.2 债券交易

注:本基金本报告期末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4月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	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	1,310,000,000.00	100.00

### 6.4.10.1.4 基金交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年4月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例(%)
东方证券股份有限公司	21,810,163.22	100.00

### 6.4.10.1.5 权证交易

注:本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年4月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中:支付销售机构的客户维护费	548,025.47

注:本基金对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人自身管理的基金所对应的资金资产净值后余额(若为负数,则取0)的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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扣除所持有本基金管理人自身管理的其他基金所对应的资金资产净值后余额, 若为负数, 则取 0

基金管理费每日计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令, 经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期
	2019 年 4 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	93,946.30

注: 本基金对基金财产中持有的本基金托管人自身托管的基金部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金托管人自身托管的基金所对应的资金资产净值后余额 (若为负数, 则取 0) 的 0.12% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.12\% \div \text{当年天数}$$

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扣除所持有本基金托管人自身托管的其他基金所对应的资金资产净值后余额, 若为负数, 则取 0

基金托管费每日计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令, 经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。

#### 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

注: 本基金的基金管理人本报告期末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 4 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	29,523,730.98	168,847.18

#### 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：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2019 年 4 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费 (元)	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费 (元)	-
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	223,350.76
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	39,890.84

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的 (ETF 除外)，应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费 (按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外)、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。



#### 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,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 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。

##### 6.4.13.3 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	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
-----	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

2019 年 6 月 30 日							
资产							
银行存款	29,523,730.98	70,000,000.00	-	-	-	-	99,523,730.98
结算备付金	5,175,252.56	-	-	-	-	-	-5,175,252.56
存出保证金	3,885.13	-	-	-	-	-	3,885.13
交易性金融资产	-	-	-	-	-	381,613,998.59	381,613,998.59
应收利息	-	-	-	-	-	333,548.24	333,548.24
应收股利	-	-	-	-	-	39,936.54	39,936.54
应收申购款	249.63	-	-	-	-	104,258.46	104,508.09
其他资产	-	-	-	-	-	177.20	177.20
资产总计	34,703,118.30	70,000,000.00	-	-	-	382,091,919.03	486,795,037.33
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	216,408.35	216,408.35
应付托管费	-	-	-	-	-	44,519.12	44,519.12
其他负债	-	-	-	-	-	40,809.51	40,809.51
负债总计	-	-	-	-	-	301,736.98	301,736.98
利率敏感度缺	34,703,118.30	70,000,000.00	-	-	-	381,790,182.05	486,493,300.35

□							
---	--	--	--	--	--	--	--

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

注:本基金本报告期末及上年度末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款,且均以活期存款利率或相对固定的利率计息,买入返售金融资产利息收益在交易时已确定,不受利率变化影响;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

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。

#### 6.4.14 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	381,613,998.59	78.39
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	104,698,983.54	21.51
8	其他各项资产	482,055.20	0.10
9	合计	486,795,037.33	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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

## 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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末持有股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

## 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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

## 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:本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 7.11.1 投资政策及风险说明

本基金为基金中基金,基金随着所设定目标日期的临近,逐步降低权益类资产的配置比例,增加非权益类资产的配置比例,从而逐步降低本基金波动风险。本基金为混合型基金中基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金,高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。

#### 7.11.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	110011 OTC	易方达中小盘混合	契约型开放式	6,660,503.93	33,090,715.63	6.80	否
2	519062 OTC	海富通阿尔法对冲混合	契约型开放式	24,330,089.21	30,607,252.23	6.29	否
3	519688 OTC	交银精选混合	契约型开放式	42,394,625.17	30,379,988.40	6.24	否
4	001316 OTC	安信稳健增值混合A	契约型开放式	23,854,492.16	30,268,965.10	6.22	否
5	519066 OTC	汇添富蓝筹稳健混	契约型开放式	10,356,934.46	26,472,324.48	5.44	是

		合					
6	505888 SH	嘉实 元和 混合	契约 型封 闭式	22,587,769.00	22,339,303.54	4.59	否
7	002864 OTC	广发 安泽 短债 债券 A	契约 型开 放式	20,779,257.58	22,102,896.29	4.54	否
8	040008 OTC	华安 策略 优选 混合	契约 型开 放式	12,398,732.59	21,856,485.81	4.49	否
9	519068 OTC	汇添 富成 长焦 点混 合	契约 型开 放式	10,218,679.75	21,599,223.39	4.44	是
10	519069 OTC	汇添 富价 值精 选混 合 A	契约 型开 放式	8,788,818.25	21,550,182.35	4.43	是
11	519517 OTC	汇添 富货 币 B	契约 型开 放式	21,586,645.22	21,586,645.22	4.44	是
12	470006 OTC	汇添 富医 药保 健混 合 A	契约 型开 放式	15,015,091.18	21,516,625.66	4.42	是
13	000173 OTC	汇添 富美 丽 30 混合	契约 型开 放式	8,965,141.42	20,431,557.30	4.20	是

14	519222 OTC	海富 通欣 益混 合 A	契约 型开 放式	17,666,961.13	20,264,004.42	4.17	否
15	001816 OTC	汇添 富新 睿精 选混 合 A	契约 型开 放式	17,406,440.38	20,156,657.96	4.14	是
16	000762 OTC	汇添 富绝 对收 益定 开混 合	契约 型开 放式	14,370,245.14	17,431,107.35	3.58	是

注:本基金本报告期末投资于本基金管理人以及关联方所管理基金的公允价值为 170,744,323.71 元,占期末净值比例 35.10%。

## 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	3,885.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	39,936.54
4	应收利息	333,548.24
5	应收申购款	104,508.09
6	其他应收款	177.20
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	482,055.20



### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金报告期末未持有可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

## § 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 (%)
17,026	27,729.38	1,996,007.98	0.42	470,124,421.30	99.58

### 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	114,146.15	0.02

### 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	0~10
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 (2019 年 4 月 29 日) 基金份额总额	471,716,422.66
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	404,006.62
减:基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金 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	472,120,429.28

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

2019 年 1 月, 中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月, 中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

本报告期内, 本基金管理人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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)自本基金合同生效日(2019 年 4 月 29 日)起至本报告期末, 为本基金进行审计。

### 10.7 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。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 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	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

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

10.8.2 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
东方证券	-	-	1,310,000,000.00	100.00%	-	-	21,810,163.22	100.00%
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-

兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东 方财富	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 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 1 家证券公司的 1 个交易单元:东方证券(深交所单元)。

## 10.9 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	汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金发售文件	公司网站, 证券日报	2019-03-23
2	关于汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金 (FOF) 通过网上直销认购费率优惠的公告	公司网站, 证券日报	2019-03-30
3	关于汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金 (FOF) 增加代销机构的公告	公司网站, 证券日报	2019-04-04
4	关于汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金 (FOF) 增加代销机构的公告	上证报, 公司网站	2019-04-05
5	关于汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金 (FOF) 增加代销机构的公告	上证报, 公司网站	2019-04-08
6	关于汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金 (FOF) 增加代销机构的公告	公司网站, 证券日报	2019-04-09
7	关于汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金 (FOF) 增加代销机构的公告	公司网站, 证券日报	2019-04-12
8	关于汇添富养老目标日期 2040 五年	公司网站, 证券日报	2019-04-17

	持有期混合型基金中基金（FOF）增加代销机构的公告		
9	关于汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金（FOF）增加代销机构的公告	公司网站, 证券日报	2019-04-19
10	关于汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金（FOF）增加代销机构的公告	公司网站, 证券日报	2019-04-24
11	汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同生效公告	公司网站, 证券日报	2019-04-30
12	关于汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常申购及定期定额投资业务公告	公司网站, 证券日报	2019-05-06
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加蚂蚁基金为代销机构的公告	证券时报, 公司网站	2019-06-19

## § 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养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金（FOF）募集的文件；
- 2、《汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金（FOF）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