

汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）

2018 年半年度报告

2018 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：中国国际金融股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 25 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。

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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 2018 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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息.....	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	58
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	64

§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）	
基金简称	汇添富沪深 300 指数（LOF）	
基金主代码	501043	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2017 年 9 月 6 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国国际金融股份有限公司	
报告期末基金份额总额	100,059,448.77 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2017 年 10 月 9 日	
下属分级基金的基金简称：	汇添富沪深 300 指数（LOF）A	汇添富沪深 300 指数（LOF）C
下属分级基金场内简称：	沪深 300A	沪深 300C
下属分级基金的交易代码：	501043	501045
报告期末下属分级基金的份额总额	62,536,571.82 份	37,522,876.95 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国国际金融股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	张萱

	联系电话	021-28932888	010-65051166-1553
	电子邮箱	service@99fund.com	CICC_AC@cicc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	010-65051166
传真		021-28932998	010-65059873
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市朝阳区建外门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址		上海市富城路99号震旦国际大楼19-22层	北京市朝阳区建外门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
邮政编码		200120	100004
法定代表人		李文	毕明建（代）

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》、《上海证券报》和《证券时报》
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19-22层 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

基金级别	汇添富沪深 300 指数（LOF）A	汇添富沪深 300 指数（LOF）C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,863,211.64	1,811,136.85
本期利润	-4,714,955.55	-3,560,630.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0753	-0.0861
本期加权平均净值利润率	-7.37%	-8.42%
本期基金份额净值增长率	-10.32%	-10.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-4,628,477.95	-2,803,998.42
期末可供分配基金份额利润	-0.0740	-0.0747
期末基金资产净值	57,908,093.87	34,718,878.53
期末基金份额净值	0.9260	0.9253
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-7.40%	-7.47%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富沪深 300 指数（LOF）A

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	-6.43%	1.25%	-7.29%	1.22%	0.86%	0.03%
过去三个月	-7.94%	1.09%	-9.45%	1.08%	1.51%	0.01%
过去六个月	-10.32%	1.10%	-12.25%	1.10%	1.93%	0.00%
自基金合同	-7.40%	0.95%	-8.49%	0.95%	1.09%	0.00%

生效日起至 今						
------------	--	--	--	--	--	--

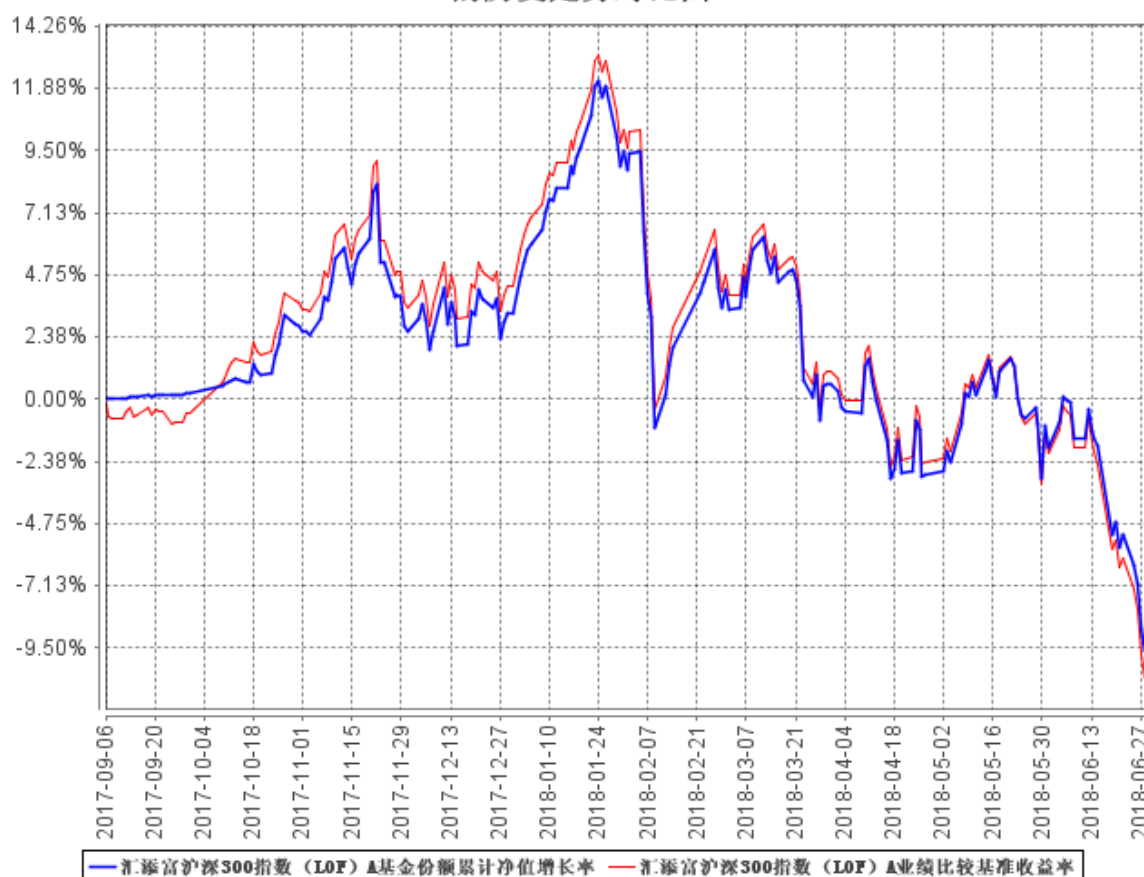
汇添富沪深 300 指数（LOF）C

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	-6.44%	1.25%	-7.29%	1.22%	0.85%	0.03%
过去三个月	-7.98%	1.09%	-9.45%	1.08%	1.47%	0.01%
过去六个月	-10.39%	1.10%	-12.25%	1.10%	1.86%	0.00%
自基金合同 生效日起至 今	-7.47%	0.95%	-8.49%	0.95%	1.02%	0.00%

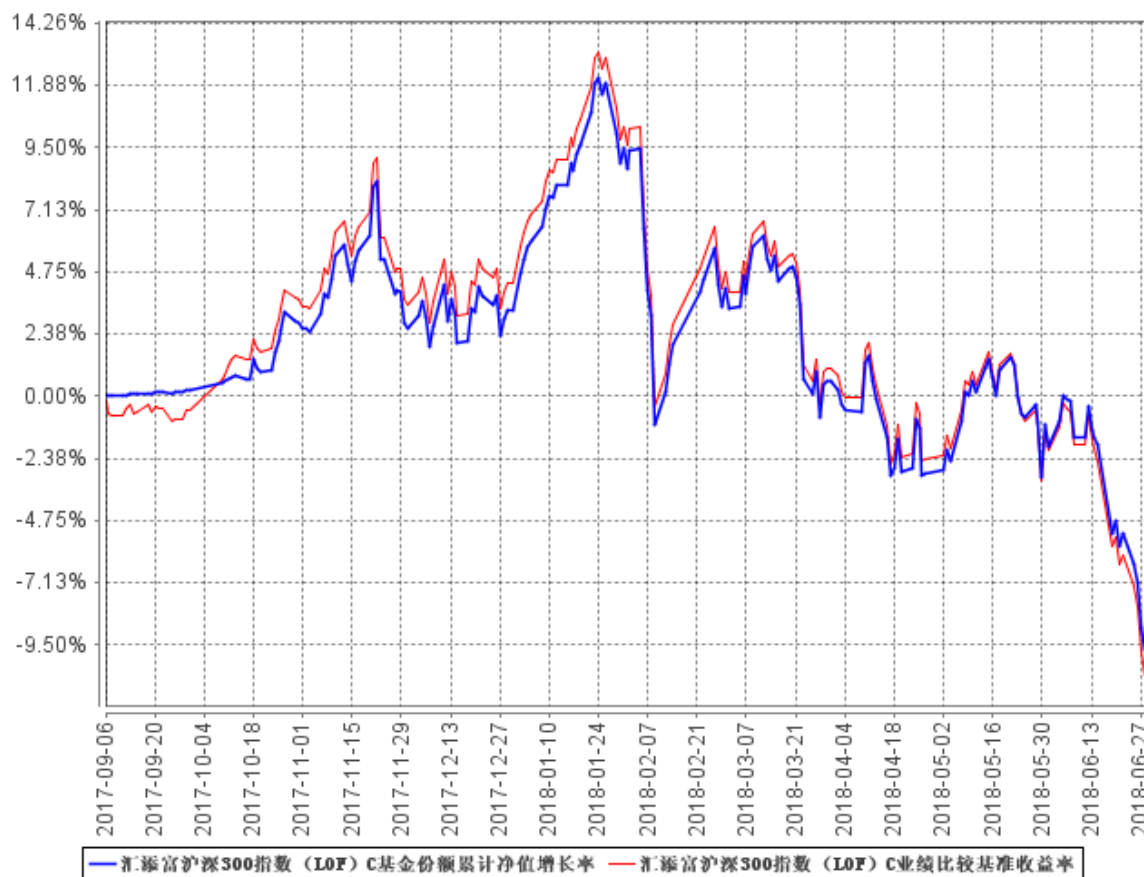
注：本基金的《基金合同》生效日为 2017 年 09 月 06 日，至本报告期末未满 1 年。

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

汇添富沪深300指数（LOF）A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富沪深300指数 (LOF) C基金份额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 2017 年 09 月 06 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（2017 年 09 月 06 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由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，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，注册资本金为 132,724,224 元人民币。截止到 2018 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 4213.15 亿元，有效客户数约 1988 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 110 只开放式证券投资基金，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，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长混合型证券投资基金、汇添富成长焦点混合型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富民营活力混合型证券投资基金、汇添富香港优势混合型证券投资基金、汇添富医药保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富优选回报混合型证券投资基金、汇添富消费行业混合型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽 30 混合型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富添富通货币市场基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资

资基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富成长多因子量化策略股票基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务混合型证券投资基金、汇添富国企创新增长股票型证券投资基金、汇添富民营新动力股票型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富新兴消费股票型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金、汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富盈安保本混合型证券投资基金、汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金、汇添富盈稳保本混合型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫保本混合型证券投资基金、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金、汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）、汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金、汇添富鑫利债券型证券投资基金、汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、汇添富中国高端制造股票型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富精选美元债债券型证券投资基金、汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金、汇添富添福吉祥混合型证券投资基金、汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金、汇添富盈润混合型证券投资基金、汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富民丰回报混合型证券投资基金、汇添富睿丰混合型证券投资基金、汇添富弘安混合型证券投资基金、汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金、汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）、上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金、汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金、汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金、汇添富行业整合主题混合型证券投资基金、汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金、汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富智能制造股票型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富文体

娱乐主题混合型证券投资基金。

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		
楚天舒	中证上海国企 ETF、上海国企 ETF 联接、汇添富沪深 300 指数（LOF）、上证上海改革发展主题 ETF、汇添富中证全指证券公司指数（LOF）的基金经理，指数与量化投资部副总监。	2017 年 9 月 6 日	-	18 年	国籍：中国。学历：南开大学经济学博士。从业经历：曾任职于深圳商业银行、华安证券、华富基金管理公司、深圳证券交易所、上海证券交易所、华宝兴业基金管理公司，2014 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部副总监。2016 年 8 月 8 日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理，2016 年 9 月 18 日至今任上海国企 ETF 联接的基金经理，2017 年 9 月 6 日至今任汇添富沪深 300 指数（LOF）的基金经理，2017 年 12 月 1 日至今担任上证上海改革发展主题 ETF 的基金经理，2017 年 12 月 4 日至今担任汇添富中证全指证券公司指数（LOF）的基金经理。
董瑾	上海国企 ETF 联接、上证上海改革发展主题 ETF、汇添富沪深 300 指数（LOF）、汇添富中证全指证券公司指数（LOF）的基金经	2017 年 12 月 18 日	-	9 年	国籍：中国。北京大学西方经济学硕士，8 年证券从业经历。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 8 月至 2012 年 12 月任国泰基金管理有限公司产品经理助理，2012 年 12 月至 2015 年 9 月任汇添富基金管理股份有限公司产品经理，2015 年 9 月至 2016 年 10 月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016 年 11 月加入汇

	理助理。				添富基金管理股份有限公司，2017 年 12 月 18 日至今任上海国企 ETF 联接、上证上海改革发展主题 ETF、汇添富沪深 300 指数（LOF）、汇添富中证全指证券公司指数（LOF）的基金经理助理。
--	------	--	--	--	---

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 4 次，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年宏观经济运行总体平稳，经济增长表现出较强韧性。2018 年上半年 GDP 同比增长 6.8%，经济运行总体保持平稳。今年以来，在金融严监管、结构性去杠杆、房地产调控持续实施的背景下，宏观经济增长展现出较强韧性。

上半年，特朗普税改法案生效、美国经济温和复苏、美联储加息刺激美元指数走强，中美贸易摩擦不断升级、个别国家贸易保护主义抬头、风险规避情绪上升等导致新兴市场面临资本流出及汇率贬值压力。在上述外部条件的综合作用下，尤其是美元指数走高影响下，人民币兑美元汇率承压，双向波动态势明显。

从市场上来看，2017 年，金融严监管对于市场各种不规范以及加杠杆的行为予以坚决打压，价值股、蓝筹股全年表现较好；而在 2018 年，出于加速经济新旧动能转换以及满足战略新兴产业融资需要，对“新经济”企业有一定的倾斜，市场风险偏好走向再平衡，配置也走向均衡。2018 年以来市场波动率有所上升，市场风格切换也更加频繁。从估值来看，当前估值已处于历史较低水平，具有较高的安全边际。

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富沪深 300 指数（LOF）A 基金份额净值为 0.9260 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.32%；截至本报告期末汇添富沪深 300 指数（LOF）C 基金份额净值为 0.9253 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.39%；同期业绩比较基准收益率为-12.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年金融严监管态势仍会延续，货币政策向偏松方向微调继续对金融体系流动性提供支持，但“紧信用”环境将难现明显改观，内需扩张动力将持续承压。与此同时，下半年中美双方互相加征关税正式落地，双方将进入“边打边谈”阶段，不排除贸易摩擦进一步升温的可能。由此，下半年国内外经济环境均将趋紧，宏观经济增速下行压力也将有所加大。预计下半年 GDP 增速将

较 2017 年有所下滑，仍然保持在中高速增长区间，经济增长结构继续优化。

市场方面，在经济保持韧性的前提下加快结构调整。同时下半年外部扰动因素仍然较多，在经济和货币政策传导层面，美联储年内加息的节拍仍然存在扰动市场的可能。在地缘政策因素上，中美贸易摩擦短期难以结束，虽然短期已经经过最大影响的时刻，但在 A 股市场具有一定的放大效应，反复多次博弈下将对市场带来持续扰动。行业方面，建议关注受益政府推进改革的医药、医疗保健、军工、半导体，受益消费升级范围下沉大趋势的大众消费；同时，大金融板块长期来看依然是核心资产，供给侧结构性改革下行业竞争格局改变后的周期股中具有竞争优势的龙头也或存在结构性机会。

作为被动投资的指数型基金，汇添富沪深 300 指数（LOF）将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

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《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等相关规定和基金合同的约定，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。

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。

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，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

本基金本报告期末进行利润分配。

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合规守信情况声明

本报告期内，中国国际金融股份有限公司（以下称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行收益分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	5,397,097.62	7,282,292.27
结算备付金		36,073.92	87,605.51
存出保证金		87,105.96	150,509.41
交易性金融资产	6.4.7.2	87,466,584.49	138,842,589.96
其中：股票投资		87,466,584.49	138,766,889.96
基金投资		-	-
债券投资		-	75,700.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	652,702.07
应收利息	6.4.7.5	2,119.23	3,593.53
应收股利		-	-
应收申购款		1,152,468.35	200,686.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		94,141,449.57	147,219,979.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		683,526.62	-
应付赎回款		513,645.56	458,035.57
应付管理人报酬		38,452.63	65,117.23
应付托管费		7,690.51	13,023.47
应付销售服务费		7,480.03	13,151.68
应付交易费用	6.4.7.7	25,244.53	231,986.54

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	238,437.29	201,562.75
负债合计		1,514,477.17	982,877.24
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	100,059,448.77	141,619,224.54
未分配利润	6.4.7.10	-7,432,476.37	4,617,877.67
所有者权益合计		92,626,972.40	146,237,102.21
负债和所有者权益总计		94,141,449.57	147,219,979.45

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，其中下属 A 类基金份额参考净值 0.9260 元，份额总额 62,536,571.82 份；下属 C 类基金份额参考净值 0.9253 元，份额总额 37,522,876.95 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		-7,555,977.41
1.利息收入		49,371.46
其中：存款利息收入	6.4.7.11	49,351.35
债券利息收入		20.11
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）		5,307,772.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,383,985.56
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	12,556.67
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	911,230.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-12,949,934.23
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	36,813.00
减：二、费用		719,608.33

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	262,771.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	52,554.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	52,359.38
4. 交易费用	6.4.7.19	141,108.24
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	6.4.7.20	210,815.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,275,585.74

注：本基金合同于 2017 年 09 月 06 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示本期数据，特此说明。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	141,619,224.54	4,617,877.67	146,237,102.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,275,585.74	-8,275,585.74
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）	-41,559,775.77	-3,774,768.30	-45,334,544.07
其中：1.基金申购款	44,862,861.49	407,900.13	45,270,761.62
2.基金赎回款	-86,422,637.26	-4,182,668.43	-90,605,305.69
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）	100,059,448.77	-7,432,476.37	92,626,972.40

注：本基金合同于 2017 年 9 月 6 日生效，无比较式的上年可比期间，因此所有者权益（基金净值）

变动表只列示本期数据，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：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1332 号文《关于准予汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司作为基金发起人于 2017 年 8 月 28 日至 2017 年 8 月 31 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2017)验字第 60466941_B31 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2017 年 9 月 6 日生效。本基金为上市契约型开放式（LOF），存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 512,717,098.30 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 106,378.48 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 512,823,476.78 元，折合 512,823,476.78 份基金份额。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（分离交易可转债）、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款）、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	5,397,097.62
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：	5,397,097.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	95,705,456.45	87,466,584.49	-8,238,871.96
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	95,705,456.45	87,466,584.49	-8,238,871.96

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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,069.37
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	14.58
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	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	35.28
合计	2,119.23

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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	25,244.53
银行间市场应付交易费用	—
合计	25,244.53

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	188,765.71
应付审计费	39,671.58

应付指数使用费	10,000.00
合计	238,437.29

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富沪深 300 指数（LOF）A		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	86,997,683.61	86,997,683.61
本期申购	21,462,128.37	21,462,128.37
本期赎回(以“-”号填列)	-45,923,240.16	-45,923,240.16
— 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	62,536,571.82	62,536,571.82

金额单位：人民币元

汇添富沪深 300 指数（LOF）C		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,621,540.93	54,621,540.93
本期申购	23,400,733.12	23,400,733.12
本期赎回(以“-”号填列)	-40,499,397.10	-40,499,397.10
— 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	37,522,876.95	37,522,876.95

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

汇添富沪深 300 指数（LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,924,382.76	911,230.53	2,835,613.29
本期利润	2,863,211.64	-7,578,167.19	-4,714,955.55

本期基金份额交易产生的变动数	-760,242.00	-1,988,893.69	-2,749,135.69
其中：基金申购款	1,210,368.23	-1,343,950.80	-133,582.57
基金赎回款	-1,970,610.23	-644,942.89	-2,615,553.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,027,352.40	-8,655,830.35	-4,628,477.95

单位：人民币元

汇添富沪深 300 指数 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,210,221.74	572,042.64	1,782,264.38
本期利润	1,811,136.85	-5,371,767.04	-3,560,630.19
本期基金份额交易产生的变动数	-634,735.83	-390,896.78	-1,025,632.61
其中：基金申购款	1,236,075.84	-694,593.14	541,482.70
基金赎回款	-1,870,811.67	303,696.36	-1,567,115.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,386,622.76	-5,190,621.18	-2,803,998.42

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	46,619.34
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	314.75
其他	2,417.26
合计	49,351.35

注：其中“其他”为直销申购款利息收入和交易保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	67,234,881.61
减：卖出股票成本总额	62,850,896.05
买卖股票差价收入	4,383,985.56

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 2018年1月1日至2018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	12,556.67
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	12,556.67

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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	158,184.95
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	145,600.00
减：应收利息总额	28.28
买卖债券差价收入	12,556.67

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：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	911,230.13
基金投资产生的股利收益	-
合计	911,230.13

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-12,949,934.23
——股票投资	-12,949,934.23
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	-12,949,934.23

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	36,813.00
合计	36,813.00

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	141,108.24
银行间市场交易费用	-
合计	141,108.24

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
账户维护费	-
银行划款费	2,378.09
指数使用费	20,000.00
合计	210,815.38

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，本基金无其他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、基金发起人
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	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 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
中国国际金融股份有限公司	90,769,145.13	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
中国国际金融股份有限公司	158,184.95	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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 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
中国国际金融股份有限公司	65,810.74	100.00%	25,244.53	100.00%

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 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	262,771.13

其中：支付销售机构的客户维护费	7,712.94
-----------------	----------

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	52,554.20

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富沪深 300 指数 (LOF) A	汇添富沪深 300 指数 (LOF) C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	0.00	4,978.55	4,978.55
东方证券股份有限公司	0.00	20,037.24	20,037.24
合计	0.00	25,015.79	25,015.79

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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

份额单位：份

项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	汇添富沪深 300 指数（LOF）A	汇添富沪深 300 指数（LOF）C
基金合同生效日（2017 年 9 月 6 日）持有的基金份额	—	—
期初持有的基金份额	10,002,700.27	—
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,002,700.27	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.9950%	—

注：本公司于 2017 年 8 月 28 日用固有资金 10,001,000.00 元认购本基金份额 10,002,700.27 份（含募集期利息结转的份额），认购费用 1,000.00 元。符合招募说明书规定的认购费率。

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：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国国际金融股份有限公司	5,397,097.62	46,619.34

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参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2018 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
603693	江苏新能	2018 年 6 月 25 日	2018 年 7 月 3 日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌	期末估值单	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	----	-------	------	--------	--------	--------	--------	----

			原因	价						
600221	海航控股	2018 年 1 月 10 日	重大资产重组停牌	3.23	2018 年 7 月 20 日	2.91	124,500	403,103.99	402,135.00	-
601390	中国中铁	2018 年 5 月 7 日	重大资产重组停牌	7.47	2018 年 8 月 20 日	7.25	48,400	421,347.35	361,548.00	-
002450	康得新	2018 年 6 月 4 日	重大资产重组停牌	17.08	-	-	18,000	398,279.08	307,440.00	-
002252	上海莱士	2018 年 2 月 23 日	重大资产重组停牌	21.46	-	-	13,000	263,328.63	278,980.00	-
601727	上海电气	2018 年 6 月 6 日	重大资产重组停牌	6.34	2018 年 8 月 7 日	5.71	30,100	231,641.87	190,834.00	-
002310	东方园林	2018 年 5 月	重大	15.03	-	-	11,402	234,445.82	171,372.06	-

		月 25 日	资产重组停牌							
300072	三聚环保	2018 年 6 月 19 日	重大资产重组停牌	23.28	2018 年 7 月 10 日	24.00	6,900	237,862.88	160,632.00	-
000415	渤海金控	2018 年 1 月 17 日	重大资产重组停牌	5.84	2018 年 7 月 17 日	5.26	17,800	117,640.22	103,952.00	-
000008	神州高铁	2018 年 6 月 6 日	重大事项停牌	4.96	2018 年 8 月 7 日	4.46	14,601	126,162.31	72,420.96	-
601118	海南橡胶	2018 年 5 月 24 日	重大资产重组停牌	6.62	-	-	10,900	70,067.06	72,158.00	-
002602	世纪华通	2018 年 6 月 12 日	重大资产重组停牌	32.50	-	-	2,200	71,667.68	71,500.00	-

002411	必康股份	2018 年 6 月 19 日	重大事件停牌	28.34	-	-	2,301	61,658.73	65,210.34	-
000723	美锦能源	2018 年 3 月 27 日	重大资产重组停牌	5.43	2018 年 7 月 31 日	4.89	10,800	76,028.84	58,644.00	-

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 2018 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 2018 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。

6.4.13.3 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、存出保证金及部分应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,397,097.62	-	-	-	-	-	5,397,097.62
结算备付金	36,073.92	-	-	-	-	-	36,073.92
存出保证金	87,105.96	-	-	-	-	-	87,105.96
交易性金融资产	-	-	-	-	-	87,466,584.49	87,466,584.49
应收利息	-	-	-	-	-	2,119.23	2,119.23
应收申购款	299,153.54	-	-	-	-	853,314.81	1,152,468.35
资产总计	5,819,431.04	-	-	-	-	88,322,018.53	94,141,449.57
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	683,526.62	683,526.62
应付赎回款	-	-	-	-	-	513,645.56	513,645.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	38,452.63	38,452.63
应付托管费	-	-	-	-	-	7,690.51	7,690.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,480.03	7,480.03
应付交易费用	-	-	-	-	-	25,244.53	25,244.53
其他负债	-	-	-	-	-	238,437.29	238,437.29
负债总计	-	-	-	-	-	1,514,477.17	1,514,477.17
利率敏感度缺口	5,819,431.04	-	-	-	-	86,807,541.36	92,626,972.40
上年度末 2017 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	7,282,292.27	-	-	-	-	-	7,282,292.27
结算备付金	87,605.51	-	-	-	-	-	87,605.51
存出保证金	150,509.41	-	-	-	-	-	150,509.41
交易性金融资产	-	-	75,700.00	-	-	138,766,889.96	138,842,589.96
应收证券清算款	-	-	-	-	-	652,702.07	652,702.07
应收利息	-	-	-	-	-	3,593.53	3,593.53
应收申购款	91,263.01	-	-	-	-	109,423.69	200,686.70

资产总计	7,611,670.20	-	75,700.00	-	-	139,532,609.25	147,219,979.45
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	458,035.57	458,035.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	65,117.23	65,117.23
应付托管费	-	-	-	-	-	13,023.47	13,023.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,151.68	13,151.68
应付交易费用	-	-	-	-	-	231,986.54	231,986.54
其他负债	-	-	-	-	-	201,562.75	201,562.75
负债总计	-	-	-	-	-	982,877.24	982,877.24
利率敏感度缺口	7,611,670.20	-	75,700.00	-	-	138,549,732.01	146,237,102.21

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，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；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的债券，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	87,466,584.49	92.91
	其中：股票	87,466,584.49	92.91
2	基金投资	—	—
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	5,433,171.54	5.77
8	其他各项资产	1,241,693.54	1.32
9	合计	94,141,449.57	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	124,488.00	0.13
B	采矿业	2,834,059.41	3.06
C	制造业	36,974,406.27	39.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,341,749.00	2.53
E	建筑业	3,031,230.95	3.27
F	批发和零售业	1,708,618.46	1.84
G	交通运输、仓储和邮政业	2,921,236.54	3.15
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,243,067.48	3.50
J	金融业	27,508,693.85	29.70

K	房地产业	3,841,564.00	4.15
L	租赁和商务服务业	1,328,124.60	1.43
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	314,862.60	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	481,003.40	0.52
R	文化、体育和娱乐业	453,763.20	0.49
S	综合	-	-
	合计	87,106,867.76	94.04

7.2.2 期末积极投资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	72,158.00	0.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	134,772.74	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	359,716.73	0.39

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	88,200	5,166,756.00	5.58
2	600519	贵州茅台	4,100	2,998,986.00	3.24
3	600036	招商银行	84,200	2,226,248.00	2.40
4	000333	美的集团	37,400	1,953,028.00	2.11
5	000651	格力电器	39,100	1,843,565.00	1.99
6	601166	兴业银行	101,800	1,465,920.00	1.58
7	600887	伊利股份	49,534	1,381,998.60	1.49
8	600276	恒瑞医药	18,191	1,378,150.16	1.49
9	600016	民生银行	193,400	1,353,800.00	1.46
10	601328	交通银行	225,000	1,291,500.00	1.39
11	000858	五粮液	16,101	1,223,676.00	1.32
12	002415	海康威视	30,000	1,113,900.00	1.20
13	601288	农业银行	312,670	1,075,584.80	1.16
14	600030	中信证券	64,100	1,062,137.00	1.15
15	600104	上汽集团	28,400	993,716.00	1.07
16	000002	万科 A	39,500	971,700.00	1.05
17	601398	工商银行	175,500	933,660.00	1.01
18	601668	中国建筑	170,980	933,550.80	1.01
19	600000	浦发银行	95,800	915,848.00	0.99
20	600900	长江电力	54,300	876,402.00	0.95
21	601601	中国太保	25,500	812,175.00	0.88
22	601169	北京银行	121,400	732,042.00	0.79
23	600048	保利地产	57,800	705,160.00	0.76
24	000725	京东方 A	193,200	683,928.00	0.74
25	002304	洋河股份	5,003	658,394.80	0.71
26	000001	平安银行	70,000	636,300.00	0.69
27	600837	海通证券	66,300	627,861.00	0.68
28	601988	中国银行	172,509	622,757.49	0.67
29	600309	万华化学	13,400	608,628.00	0.66

30	600690	青岛海尔	30,001	577,819.26	0.62
31	002027	分众传媒	59,880	573,051.60	0.62
32	600019	宝钢股份	72,500	564,775.00	0.61
33	600518	康美药业	24,501	560,582.88	0.61
34	600028	中国石化	85,803	556,861.47	0.60
35	600585	海螺水泥	16,201	542,409.48	0.59
36	601888	中国国旅	8,000	515,280.00	0.56
37	601229	上海银行	31,900	502,744.00	0.54
38	603288	海天味业	6,600	486,024.00	0.52
39	601818	光大银行	130,300	476,898.00	0.51
40	601766	中国中车	59,600	458,920.00	0.50
41	601211	国泰君安	30,700	452,518.00	0.49
42	000538	云南白药	4,208	450,087.68	0.49
43	600009	上海机场	7,900	438,292.00	0.47
44	002024	苏宁易购	30,100	423,808.00	0.46
45	601857	中国石油	53,300	410,943.00	0.44
46	601939	建设银行	62,490	409,309.50	0.44
47	600221	海航控股	124,500	402,135.00	0.43
48	601006	大秦铁路	48,800	400,648.00	0.43
49	601688	华泰证券	26,600	398,202.00	0.43
50	600015	华夏银行	52,400	390,380.00	0.42
51	300059	东方财富	29,460	388,282.80	0.42
52	600703	三安光电	19,801	380,575.22	0.41
53	002230	科大讯飞	11,800	378,426.00	0.41
54	600050	中国联通	76,200	374,904.00	0.40
55	601009	南京银行	48,400	374,132.00	0.40
56	000568	泸州老窖	6,101	371,306.86	0.40
57	001979	招商蛇口	19,400	369,570.00	0.40
58	002008	大族激光	6,901	367,064.19	0.40
59	600919	江苏银行	56,900	364,729.00	0.39
60	601390	中国中铁	48,400	361,548.00	0.39
61	002594	比亚迪	7,402	352,927.36	0.38
62	002475	立讯精密	15,400	347,116.00	0.37
63	000338	潍柴动力	39,400	344,750.00	0.37
64	600196	复星医药	8,301	343,578.39	0.37
65	600031	三一重工	37,800	339,066.00	0.37
66	002142	宁波银行	20,601	335,590.29	0.36
67	601186	中国铁建	37,600	324,112.00	0.35
68	601088	中国神华	16,201	323,047.94	0.35

69	000776	广发证券	24,200	321,134.00	0.35
70	300003	乐普医疗	8,700	319,116.00	0.34
71	002236	大华股份	14,100	317,955.00	0.34
72	600741	华域汽车	13,100	310,732.00	0.34
73	601899	紫金矿业	85,400	308,294.00	0.33
74	002450	康得新	18,000	307,440.00	0.33
75	601628	中国人寿	13,600	306,272.00	0.33
76	601989	中国重工	75,300	304,212.00	0.33
77	600660	福耀玻璃	11,401	293,119.71	0.32
78	601336	新华保险	6,800	291,584.00	0.31
79	002466	天齐锂业	5,847	289,952.73	0.31
80	000963	华东医药	5,988	288,921.00	0.31
81	600867	通化东宝	11,800	282,846.00	0.31
82	603799	华友钴业	2,900	282,663.00	0.31
83	600436	片仔癀	2,500	279,825.00	0.30
84	002252	上海莱士	13,000	278,980.00	0.30
85	300124	汇川技术	8,200	269,124.00	0.29
86	600958	东方证券	29,400	268,422.00	0.29
87	601225	陕西煤业	32,600	267,972.00	0.29
88	601012	隆基股份	15,820	264,035.80	0.29
89	000100	TCL 集团	89,000	258,100.00	0.28
90	000063	中兴通讯	19,701	256,704.03	0.28
91	600999	招商证券	18,700	255,816.00	0.28
92	600795	国电电力	96,900	253,878.00	0.27
93	600352	浙江龙盛	21,101	252,156.95	0.27
94	300015	爱尔眼科	7,800	251,862.00	0.27
95	600340	华夏幸福	9,700	249,775.00	0.27
96	002460	赣锋锂业	6,450	248,841.00	0.27
97	002456	欧菲科技	15,400	248,402.00	0.27
98	600029	南方航空	28,797	243,334.65	0.26
99	600886	国投电力	33,400	242,818.00	0.26
100	000166	申万宏源	55,200	241,224.00	0.26
101	600487	亨通光电	10,780	237,699.00	0.26
102	601933	永辉超市	31,100	237,604.00	0.26
103	600406	国电南瑞	15,000	237,000.00	0.26
104	600271	航天信息	9,100	229,957.00	0.25
105	002044	美年健康	10,139	229,141.40	0.25
106	601901	方正证券	34,200	228,798.00	0.25
107	601155	新城控股	7,300	226,081.00	0.24

108	601607	上海医药	9,400	224,660.00	0.24
109	600011	华能国际	34,400	218,784.00	0.24
110	601111	中国国航	24,601	218,702.89	0.24
111	601985	中国核电	38,300	216,395.00	0.23
112	600115	东方航空	32,600	215,812.00	0.23
113	000895	双汇发展	8,100	213,921.00	0.23
114	300070	碧水源	15,300	213,129.00	0.23
115	600516	方大炭素	8,700	212,106.00	0.23
116	600570	恒生电子	4,001	211,852.95	0.23
117	600089	特变电工	30,400	210,672.00	0.23
118	002202	金风科技	16,600	209,824.00	0.23
119	601600	中国铝业	54,100	207,744.00	0.22
120	600066	宇通客车	10,800	207,252.00	0.22
121	600111	北方稀土	17,800	202,564.00	0.22
122	601669	中国电建	37,500	201,000.00	0.22
123	300408	三环集团	8,500	199,750.00	0.22
124	300136	信维通信	6,500	199,745.00	0.22
125	601377	兴业证券	37,900	199,733.00	0.22
126	000423	东阿阿胶	3,702	199,204.62	0.22
127	600606	绿地控股	29,800	194,892.00	0.21
128	000069	华侨城 A	26,800	193,764.00	0.21
129	600535	天士力	7,404	191,171.28	0.21
130	601727	上海电气	30,100	190,834.00	0.21
131	000413	东旭光电	31,200	189,072.00	0.20
132	600588	用友网络	7,690	188,481.90	0.20
133	600383	金地集团	18,400	187,496.00	0.20
134	600398	海澜之家	14,600	186,004.00	0.20
135	000503	国新健康	5,800	184,324.00	0.20
136	002736	国信证券	20,100	182,910.00	0.20
137	300122	智飞生物	3,900	178,386.00	0.19
138	601788	光大证券	16,100	176,778.00	0.19
139	000768	中航飞机	11,300	176,732.00	0.19
140	600522	中天科技	20,000	176,200.00	0.19
141	600332	白云山	4,603	175,144.15	0.19
142	600176	中国巨石	17,100	174,933.00	0.19
143	600010	宝钢股份	111,600	172,980.00	0.19
144	000783	长江证券	31,800	172,674.00	0.19
145	002310	东方园林	11,402	171,372.06	0.19
146	002572	索菲亚	5,300	170,554.00	0.18

147	600705	中航资本	36,500	170,455.00	0.18
148	600893	航发动力	7,400	165,168.00	0.18
149	600068	葛洲坝	22,600	162,946.00	0.18
150	002241	歌尔股份	15,901	162,031.19	0.17
151	600637	东方明珠	10,701	161,157.06	0.17
152	300072	三聚环保	6,900	160,632.00	0.17
153	600085	同仁堂	4,502	158,830.56	0.17
154	600177	雅戈尔	20,500	157,850.00	0.17
155	600674	川投能源	18,100	157,832.00	0.17
156	601877	正泰电器	7,000	156,240.00	0.17
157	600023	浙能电力	33,400	155,644.00	0.17
158	601998	中信银行	25,000	155,250.00	0.17
159	300024	机器人	8,900	154,860.00	0.17
160	601919	中远海控	31,300	153,996.00	0.17
161	600739	辽宁成大	10,100	153,318.00	0.17
162	000157	中联重科	36,600	150,426.00	0.16
163	002007	华兰生物	4,602	148,000.32	0.16
164	601198	东兴证券	11,300	147,352.00	0.16
165	600018	上港集团	24,700	147,212.00	0.16
166	601618	中国中冶	44,000	146,520.00	0.16
167	600547	山东黄金	6,100	145,912.00	0.16
168	000425	徐工机械	34,400	145,856.00	0.16
169	002493	荣盛石化	14,100	145,512.00	0.16
170	000625	长安汽车	15,900	143,100.00	0.15
171	601800	中国交建	12,501	142,386.39	0.15
172	300144	宋城演艺	6,000	141,000.00	0.15
173	600804	鹏博士	11,700	140,400.00	0.15
174	601997	贵阳银行	11,200	138,432.00	0.15
175	600809	山西汾酒	2,200	138,358.00	0.15
176	000623	吉林敖东	7,600	136,648.00	0.15
177	601018	宁波港	32,400	136,404.00	0.15
178	600362	江西铜业	8,500	134,725.00	0.15
179	601555	东吴证券	19,700	134,551.00	0.15
180	600208	新湖中宝	35,200	134,464.00	0.15
181	600926	杭州银行	12,000	133,080.00	0.14
182	601099	太平洋	56,300	131,742.00	0.14
183	600100	同方股份	15,000	131,700.00	0.14
184	002081	金螳螂	13,000	131,300.00	0.14
185	002065	东华软件	15,202	130,737.20	0.14

186	002050	三花智控	6,900	130,065.00	0.14
187	600816	安信信托	17,920	129,740.80	0.14
188	000786	北新建材	6,900	127,857.00	0.14
189	603833	欧派家居	1,000	127,530.00	0.14
190	300017	网宿科技	11,902	127,470.42	0.14
191	002294	信立泰	3,400	126,378.00	0.14
192	002714	牧原股份	2,800	124,488.00	0.13
193	002146	荣盛发展	14,200	123,966.00	0.13
194	600482	中国动力	7,101	123,912.45	0.13
195	600109	国金证券	17,300	123,003.00	0.13
196	600219	南山铝业	45,200	122,492.00	0.13
197	000792	盐湖股份	11,302	122,287.64	0.13
198	000728	国元证券	16,500	122,100.00	0.13
199	603858	步长制药	2,800	119,812.00	0.13
200	002508	老板电器	3,902	119,479.24	0.13
201	002558	巨人网络	5,000	118,900.00	0.13
202	600297	广汇汽车	20,211	118,436.46	0.13
203	601333	广深铁路	27,800	118,150.00	0.13
204	603993	洛阳钼业	18,700	117,623.00	0.13
205	002797	第一创业	17,200	116,444.00	0.13
206	000630	铜陵有色	51,500	113,815.00	0.12
207	600498	烽火通信	4,502	111,874.70	0.12
208	600170	上海建工	36,600	111,264.00	0.12
209	000876	新希望	17,200	109,048.00	0.12
210	600438	通威股份	15,800	109,020.00	0.12
211	002624	完美世界	3,500	108,535.00	0.12
212	601117	中国化学	16,100	108,353.00	0.12
213	002673	西部证券	14,302	107,980.10	0.12
214	000839	中信国安	22,500	106,425.00	0.11
215	600549	厦门钨业	6,903	104,787.54	0.11
216	600153	建发股份	11,600	104,284.00	0.11
217	000415	渤海金控	17,800	103,952.00	0.11
218	000709	河钢股份	34,800	102,660.00	0.11
219	000826	启迪桑德	5,820	101,733.60	0.11
220	002085	万丰奥威	10,700	100,580.00	0.11
221	000060	中金岭南	20,350	98,901.00	0.11
222	600977	中国电影	6,101	97,860.04	0.11
223	601633	长城汽车	9,900	97,218.00	0.10
224	000983	西山煤电	12,900	96,879.00	0.10

225	600489	中金黄金	14,200	96,844.00	0.10
226	600415	小商品城	22,300	96,113.00	0.10
227	600038	中直股份	2,400	95,976.00	0.10
228	601360	三六零	3,300	95,370.00	0.10
229	000961	中南建设	15,100	95,281.00	0.10
230	600663	陆家嘴	6,000	94,740.00	0.10
231	600583	海油工程	18,000	94,680.00	0.10
232	002352	顺丰控股	2,100	94,500.00	0.10
233	600188	兖州煤业	7,200	93,888.00	0.10
234	002500	山西证券	13,901	93,692.74	0.10
235	601216	君正集团	27,400	92,338.00	0.10
236	600118	中国卫星	4,801	91,699.10	0.10
237	600820	隧道股份	15,400	91,014.00	0.10
238	600157	永泰能源	50,800	90,424.00	0.10
239	300433	蓝思科技	4,300	90,214.00	0.10
240	600346	恒力股份	6,100	89,426.00	0.10
241	601992	金隅集团	27,100	88,888.00	0.10
242	600369	西南证券	23,000	88,550.00	0.10
243	601228	广州港	15,200	88,312.00	0.10
244	002470	金正大	12,800	88,064.00	0.10
245	601881	中国银河	10,601	86,186.13	0.09
246	600909	华安证券	14,900	85,228.00	0.09
247	002555	三七互娱	7,001	85,062.15	0.09
248	000627	天茂集团	12,100	84,942.00	0.09
249	000898	鞍钢股份	15,100	84,107.00	0.09
250	600682	南京新百	5,100	83,844.00	0.09
251	300027	华谊兄弟	13,601	83,782.16	0.09
252	600008	首创股份	19,700	83,134.00	0.09
253	601021	春秋航空	2,300	80,569.00	0.09
254	000671	阳光城	13,300	79,401.00	0.09
255	000402	金融街	9,800	78,890.00	0.09
256	002074	国轩高科	5,583	78,496.98	0.08
257	000559	万向钱潮	11,200	76,160.00	0.08
258	002153	石基信息	2,600	75,400.00	0.08
259	000938	紫光股份	1,200	75,120.00	0.08
260	002385	大北农	18,000	74,340.00	0.08
261	600376	首开股份	10,500	73,815.00	0.08
262	600704	物产中大	14,100	73,743.00	0.08
263	300251	光线传媒	7,200	73,296.00	0.08

264	601898	中煤能源	15,000	72,450.00	0.08
265	002602	世纪华通	2,200	71,500.00	0.08
266	600688	上海石化	12,000	68,280.00	0.07
267	300033	同花顺	1,700	66,079.00	0.07
268	002411	必康股份	2,301	65,210.34	0.07
269	601866	中远海发	26,100	64,989.00	0.07
270	600959	江苏有线	12,600	64,260.00	0.07
271	600061	国投资本	6,900	64,032.00	0.07
272	002601	龙麟佰利	4,900	63,357.00	0.07
273	600339	中油工程	13,800	61,962.00	0.07
274	601991	大唐发电	20,200	61,206.00	0.07
275	000723	美锦能源	10,800	58,644.00	0.06
276	601238	广汽集团	5,200	57,928.00	0.06
277	601718	际华集团	14,400	57,888.00	0.06
278	600373	中文传媒	4,500	57,825.00	0.06
279	600372	中航电子	4,301	56,171.06	0.06
280	000959	首钢股份	13,000	53,430.00	0.06
281	601611	中国核建	6,403	50,583.70	0.05
282	601958	金钼股份	7,900	49,533.00	0.05
283	601808	中海油服	4,900	46,746.00	0.05
284	603160	汇顶科技	700	45,423.00	0.05
285	600025	华能水电	14,900	45,296.00	0.05
286	002468	申通快递	2,600	44,590.00	0.05
287	603260	合盛硅业	600	42,342.00	0.05
288	002625	光启技术	3,500	40,985.00	0.04
289	601828	美凯龙	2,600	39,728.00	0.04
290	002925	盈趣科技	700	38,766.00	0.04
291	600233	圆通速递	2,800	36,960.00	0.04
292	001965	招商公路	4,500	36,630.00	0.04
293	601108	财通证券	3,200	36,096.00	0.04
294	600390	五矿资本	4,300	33,325.00	0.04
295	002608	江苏国信	4,400	30,360.00	0.03
296	601838	成都银行	3,300	28,875.00	0.03
297	601212	白银有色	6,900	28,221.00	0.03
298	601878	浙商证券	3,000	25,200.00	0.03

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例 (%)
1	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.09
2	000008	神州高铁	14,601	72,420.96	0.08
3	601118	海南橡胶	10,900	72,158.00	0.08
4	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.05
5	603650	彤程新材	2,138	45,881.48	0.05
6	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.02
7	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.02

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	601318	中国平安	1,129,408.00	0.77
2	600519	贵州茅台	567,788.00	0.39
3	603288	海天味业	559,642.00	0.38
4	600036	招商银行	493,455.00	0.34
5	601229	上海银行	413,061.85	0.28
6	000651	格力电器	370,769.00	0.25
7	600887	伊利股份	369,871.00	0.25
8	000333	美的集团	352,105.00	0.24
9	600867	通化东宝	313,904.44	0.21
10	000858	五粮液	310,448.00	0.21
11	601600	中国铝业	303,329.00	0.21
12	601166	兴业银行	301,977.00	0.21
13	600016	民生银行	296,290.00	0.20
14	002415	海康威视	281,892.00	0.19
15	601328	交通银行	275,713.00	0.19
16	600487	亨通光电	270,988.00	0.19
17	600276	恒瑞医药	250,732.00	0.17

18	600516	方大炭素	239,099.38	0.16
19	600000	浦发银行	236,099.97	0.16
20	601288	农业银行	235,277.00	0.16

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	601318	中国平安	4,211,862.00	2.88
2	600519	贵州茅台	1,964,300.00	1.34
3	600036	招商银行	1,715,573.00	1.17
4	000333	美的集团	1,328,174.00	0.91
5	000651	格力电器	1,312,643.20	0.90
6	601166	兴业银行	1,164,318.00	0.80
7	600887	伊利股份	1,142,975.14	0.78
8	600016	民生银行	1,099,287.00	0.75
9	601328	交通银行	954,648.00	0.65
10	002415	海康威视	873,611.72	0.60
11	000858	五粮液	867,878.16	0.59
12	600030	中信证券	853,204.00	0.58
13	000002	万科 A	819,304.00	0.56
14	601288	农业银行	818,899.08	0.56
15	600000	浦发银行	816,875.08	0.56
16	601668	中国建筑	743,237.00	0.51
17	601398	工商银行	736,186.00	0.50
18	600276	恒瑞医药	727,500.22	0.50
19	000725	京东方 A	725,094.00	0.50
20	601601	中国太保	664,066.00	0.45

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	24,500,524.81
卖出股票收入（成交）总额	67,234,881.61

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

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：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资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。

7.12.2

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	87,105.96
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,119.23
5	应收申购款	1,152,468.35
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,241,693.54

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000008	神州高铁	72,420.96	0.08	重大事项停牌
2	601118	海南橡胶	72,158.00	0.08	重大资产重组停牌
3	603693	江苏新能	48,456.00	0.05	新股流通受限

§ 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇添富沪深 300 指数(LOF) A	1,346	46,461.05	10,002,700.27	15.99%	52,533,871.55	84.01%
汇添富沪深 300 指数(LOF) C	1,025	36,607.68	311.44	0.00%	37,522,565.51	100.00%
合计	2,371	42,201.37	10,003,011.71	10.00%	90,056,437.06	90.00%

8.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富沪深 300 指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	刘沅璦	999,270.00	9.47%
2	郭东民	498,142.00	4.72%
3	宣首	374,477.00	3.55%
4	宣军民	325,438.00	3.08%
5	郑文毅	316,647.00	3.00%
6	蒋莉	308,191.00	2.92%
7	李杰华	298,291.00	2.83%
8	贺宪宁	278,216.00	2.64%
9	肖杭	219,604.00	2.08%
10	胡少茹	198,861.00	1.88%
11	程冬	198,861.00	1.88%
12	王清	198,861.00	1.88%

汇添富沪深 300 指数 (LOF) C

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
----	-------	----------	----------

1	李颀	950,042.00	8.97%
2	黄世平	600,027.00	5.67%
3	王立明	500,135.00	4.72%
4	闵美琪	500,090.00	4.72%
5	徐大伟	500,090.00	4.72%
6	陈令才	300,081.00	2.83%
7	吕清	275,612.00	2.60%
8	王蓉	250,045.00	2.36%
9	胡连吉	240,000.00	2.27%
10	余万明	219,422.00	2.07%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富沪深 300 指数（LOF）A	181,769.59	0.2907%
	汇添富沪深 300 指数（LOF）C	94,562.65	0.2520%
	合计	276,332.24	0.2762%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富沪深 300 指数（LOF）A	0
	汇添富沪深 300 指数（LOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富沪深 300 指数（LOF）A	0
	汇添富沪深 300 指数（LOF）C	0
	合计	0

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,700.27	10.00	10,002,700.27	10.00	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	123,085.90	0.09	0.00	0.00	-
合计	10,125,786.17	10.12	10,002,700.27	10.00	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富沪深 300 指数（LOF）A	汇添富沪深 300 指数（LOF）C
基金合同生效日（2017 年 9 月 6 日）基金份额总额	215,858,430.00	296,965,046.78
本报告期期初基金份额总额	86,997,683.61	54,621,540.93
本报告期基金总申购份额	21,462,128.37	23,400,733.12
减：本报告期基金总赎回份额	45,923,240.16	40,499,397.10
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	62,536,571.82	37,522,876.95

注：其中“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

1. 《汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 19 日正式生效, 胡昕炜先生任该基金的基金经理。
2. 《汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 25 日正式生效, 吴江宏先生任该基金的基金经理。
3. 《汇添富熙和精选混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 11 日正式生效, 曾刚先生任该基金的基金经理。
4. 《汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效, 陈加荣先生任该基金的基金经理。
5. 《汇添富行业整合主题混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效, 赵鹏程先生任该基金的基金经理。
6. 《汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效, 陈健玮先生和劳杰男先生任该基金的基金经理。
7. 基金管理人于 2018 年 2 月 14 日公告, 增聘胡娜女士担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理, 与陈加荣先生共同管理该基金。
8. 基金管理人 2018 年 3 月 2 日公告, 劳杰男先生不再担任汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的基金经理, 由李威先生单独管理该基金。
9. 基金管理人于 2018 年 3 月 2 日公告, 增聘郑慧莲女士担任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理, 与曾刚先生共同管理该基金。
10. 《汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 8 日正式生效, 李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。
11. 基金管理人于 2018 年 3 月 20 日公告, 增聘赵鹏飞先生担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理, 与陈加荣先生、胡娜女士共同管理该基金。
12. 《汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 23 日正式生效, 吴振翔先生和许一尊先生任该基金的基金经理。
13. 基金管理人于 2018 年 4 月 3 日公告, 增聘郑慧莲女士担任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 与曾刚先生共同管理该基金。
14. 《汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 16 日正式生效, 吴江宏先生和胡娜女士任该基金的基金经理。
15. 《汇添富智能制造股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 23 日正式生效, 赵鹏飞先生任该基金的基金经理。
16. 《汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 26 日正式生效, 陈加荣先生任该基金的基金经理。
17. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告, 蒋文玲女士不再担任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理, 增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理, 由徐寅喆女士单独管理该基金。
18. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告, 蒋文玲女士不再担任汇添富理财 30 天债券型证券

投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

19. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

20. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，徐寅喆女士不再担任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理，增聘陶然先生担任该基金的基金经理，由陶然先生单独管理该基金。

21. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，陆文磊先生和徐寅喆女士不再担任汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理，增聘陶然先生担任该基金的基金经理，由陶然先生单独管理该基金。

22. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，徐寅喆女士不再担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，增聘陶然先生担任该基金的基金经理，由陶然先生单独管理该基金。

23. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富货币市场基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理该基金。

24. 基金管理人 2018 年 5 月 17 日公告，韩贤旺先生和欧阳沁春先生不再担任汇添富全球移动互联网灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，由杨璿先生单独管理该基金。

25. 《汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2018 年 5 月 23 日正式生效，过蓓蓓女士任该基金的基金经理。

26. 基金管理人 2018 年 5 月 29 日公告，聘任茹奕菡为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

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

28. 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

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	
中金公司	2	90,769,145.13	100.00%	65,810.74	100.00%	-

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
中金公司	158,184.95	100.00%	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

（2）交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。

（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定, 投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成; 更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用, 基金会计应负责协助及时催缴。

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未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基金 2017 年资产净值的公告	公司网站	2018 年 1 月 2 日
2	汇添富基金管理有限公司旗下公募基金 2017 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	2018 年 1 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加好买基金为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 2 月 9 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加盈米财富为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 2 月 9 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加云湾投资为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 2 月 10 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加蛋卷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	2018 年 2 月 10 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 2 月 10 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加肯特瑞财富为代销机构并参与	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 3 月 9 日

	费率优惠活动的公告		
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加恒天明泽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	2018 年 3 月 19 日
10	关于汇添富基金管理股份有限公司旗下 93 只基金修订基金合同的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 公司网站, 深交所	2018 年 3 月 24 日
11	汇添富基金管理股份有限公司旗下 93 只基金 2017 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	2018 年 3 月 28 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加格上富信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	2018 年 3 月 30 日
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	2018 年 4 月 3 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 4 月 19 日
15	汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2018 年第 1 号）	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 4 月 20 日
16	汇添富基金旗下 99 只基金 2018 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	2018 年 4 月 21 日
17	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加长量基金为代销机构的公告_20180509	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 5 月 9 日
18	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 6 月 9 日
19	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 6 月 20 日
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加有鱼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	2018 年 6 月 21 日
21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2018 半年资	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 6 月 30 日

	产净值的公告		
--	--------	--	--

§ 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沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）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 19-22 层 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

2018 年 8 月 25 日