

# 汇添富恒生指数分级证券投资基金 2018 年 半年度报告摘要

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 25 日

## § 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 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                |                |
|-----------------|------------------|----------------|----------------|
| 基金简称            | 汇添富恒生指数分级(QDII)  |                |                |
| 场内简称            | 添富恒生             |                |                |
| 基金主代码           | 164705           |                |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                |                |
| 基金合同生效日         | 2014年3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           | 中国农业银行股份有限公司     |                |                |
| 报告期末基金份额总额      | 403,264,362.08 份 |                |                |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                |                |
| 基金份额上市的证券交易所    | 深圳证券交易所          |                |                |
| 上市日期            | 2014年4月11日       |                |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 恒生 A             | 恒生 B           | 添富恒生           |
| 下属分级基金的交易代码     | 150169           | 150170         | 164705         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 100,090,316.00   | 100,090,316.00 | 203,083,730.08 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                                                                                          |
| 投资策略   | 本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。                                                                                                                                                                                                                            |
| 业绩比较基准 | 经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%                                                                                                                                                                                                                                |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数及标的指数所表征的股票市场相似的风险收益特征，在股票基金中属于中等风险、中等收益的产品。本基金为境外证券投资的基金，主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。此外，从投资者具体持有的基金份额来看，在分级运作期内，由于基金收益分配的安排，稳健收益类的 |

|  |                                                                                                         |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 恒生 A 份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额；积极收益类的恒生 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。 |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## 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<br>负责人 | 姓名   | 李鹏                 | 贺倩                 |
|             | 联系电话 | 021-28932888       | 010-66060069       |
|             | 电子邮箱 | service@99fund.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话      |      | 400-888-9918       | 95599              |
| 传真          |      | 021-28932998       | 010-68121816       |

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目   |    | 境外资产托管人                                     |
|------|----|---------------------------------------------|
| 名称   | 中文 | 香港上海汇丰银行有限公司                                |
|      | 英文 | The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd. |
| 注册地址 |    | 香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦                           |
| 办公地址 |    | 香港九龙深旺道一号, 汇丰中心一座六楼                         |

注：本基金无境外投资顾问。

## 2.5 信息披露方式

|                      |                                     |
|----------------------|-------------------------------------|
| 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楼 汇添富基金管理股份有限公司 |

# § 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(2018年01月01日-2018年06月30日) |
|---------------|------------------------------|
| 本期已实现收益       | 39,123,970.38                |
| 本期利润          | -19,437,325.18               |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0446                      |
| 本期基金份额净值增长率   | -2.19%                       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年06月30日)            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0003                       |
| 期末基金资产净值      | 484,587,207.73               |
| 期末基金份额净值      | 1.202                        |

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段              | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|-----------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月           | -1.48% | 1.10%     | -1.88%     | 1.14%         | 0.40%  | -0.04% |
| 过去三个月           | 1.95%  | 1.07%     | 1.20%      | 1.10%         | 0.75%  | -0.03% |
| 过去六个月           | -2.19% | 1.15%     | -2.22%     | 1.17%         | 0.03%  | -0.02% |
| 过去一年            | 9.45%  | 0.97%     | 8.78%      | 0.98%         | 0.67%  | -0.01% |
| 过去三年            | 20.85% | 1.10%     | 17.29%     | 1.10%         | 3.56%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效日起至<br>今 | 32.17% | 1.02%     | 35.34%     | 1.04%         | -3.17% | -0.02% |

### 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

添富恒生累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2014 年 3 月 6 日）起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司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、汇添富收益快线货币市场基金、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 |        |                                                                                                                                                                          |
| 赖中立 | 汇添富黄金及贵金属基金（LOF）的基金经理、汇添富恒生指数分级（QDII）基金、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富中证环境治理指数（LOF）基金、汇添富优选回报混合基金、汇添富中证港股通高股息投资指数（LOF）基金的基金经理。 | 2014年3月6日       |      | 10 年   | 国籍：中国，学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属基金（LOF）的基金经理，2014年3月6日至今任汇添富恒生指数分 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>级 (QDII) 基金的基金经理，2015 年 1 月 6 日至今任汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理，2015 年 5 月 26 日至 2016 年 7 月 13 日任汇添富香港优势混合基金的基金经理，2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证环境治理指数 (LOF) 基金的基金经理，2017 年 5 月 18 日至今任汇添富优选回报混合基金的基金经理，2017 年 11 月 24 日至今任汇添富中证港股通高股息投资指数 (LOF)</p> |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |              |
|--|--|--|--|--|--------------|
|  |  |  |  |  | 基金的基<br>金经理。 |
|--|--|--|--|--|--------------|

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

## 4.3 管理人对报告期内本基金运作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。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的

单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的交易次数为 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。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 18 年上半年，香港市场在宽幅横盘整理之后迎来一波调整，指数点位回到 17 年年底点位附近。我们认为，香港市场在经历了长达两年的持续上涨后，短期的调整是正常的现象，并不改变此前以机构投资者为主导的，围绕增量资金布局和价值发现的双轮驱动逻辑。按照我们对全球市场的统计分析，香港市场依然是全球范围内估值性价比最高的市场。随着两地互联互通机制不断完善，内地投资者配置港股已相当便利，机构大资金配置港股的力度逐渐增强，港股的投资生态逐渐转变，定价权已经随着资金增量配置而转移。而从价值发现的角度来看，恒生指数是香港市场最具代表性的股票指数，涵盖了最为优质的香港市场投资标的，且其中大量优质标的具有较高的分红率，对长期配置资金具有极高吸引力。从经济基本面角度来看，在十九大之后国内经济前景乐观，海外市场也处于经济复苏带来的乐观情绪推动当中，对香港市场影响较为正面，但在中美贸易战的风险因素作用下，市场波动可能会随之加剧。

报告期内，本基金按照基金合同，按照完全复制法进行恒生指数成份股指数化投资，严控基金跟踪误差，以期给投资者带来与恒生指数一致的收益。

### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金净值增长率-2.19%，业绩比较基准收益率-2.22%，超额收益为 0.03%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年下半年的港股市场，我们认为围绕香港上市的中国各大行业龙头将继续引领市场长期向好。从估值水平来看，香港市场在经历了 2017 年的上涨之后，估值有所抬升，恒生指数的估值水平已经恢复到过去 30 年的均值水平，但一些行业的龙头上市公司随着盈利水平的不断提升，估值水平依然保持在非常具有吸引力的水平。经济基本面来看，十九大召开明确了未来长期的发展和改革目标，改革路径的明确和逐步落地将给中国经济带来新的活力，中国经济转型的步伐在改革开放 40 周年之际将继续提速，新经济蓬勃发展将给市场带来超预期的盈利提升，而传统行业如大金融板块也将在未来迎来盈利提升。国外，中美贸易冲突的不确定性会给金融市场带来冲击，但我们认为该因素将是长期且缓慢体现的，不应在短期做过度反应。从资金面来看，香港

市场依然是全球权益类资产的估值洼地，资金流入香港市场的趋势短期内不会出现反转，并且随着香港市场与国内市场互联互通机制的不断完善，国内大型机构对港股的配置将成为标配，配置比例也会得到不断提升。

综上所述，我们对未来香港市场持较为乐观的态度，恒生指数作为香港市场的标杆指数，具备非常突出的配置价值。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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：汇添富恒生指数分级证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

| 资 产             | 本期末<br>2018年06月30日         | 上年度末<br>2017年12月31日         |
|-----------------|----------------------------|-----------------------------|
| <b>资 产：</b>     |                            |                             |
| 银行存款            | 35,873,124.43              | 44,190,573.08               |
| 结算备付金           | 35,536.67                  | 8,067,077.77                |
| 存出保证金           | -                          | 101,059.80                  |
| 交易性金融资产         | 450,999,172.98             | 526,906,761.50              |
| 其中：股票投资         | 450,999,172.98             | 526,906,761.50              |
| 基金投资            | -                          | -                           |
| 债券投资            | -                          | -                           |
| 资产支持证券投资        | -                          | -                           |
| 贵金属投资           | -                          | -                           |
| 衍生金融资产          | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产        | -                          | -                           |
| 应收证券清算款         | -                          | -                           |
| 应收利息            | 7,666.57                   | 9,485.20                    |
| 应收股利            | 1,916,175.65               | 79,434.34                   |
| 应收申购款           | 326,191.90                 | 1,902,582.49                |
| 递延所得税资产         | -                          | -                           |
| 其他资产            | -                          | -                           |
| 资产总计            | 489,157,868.20             | 581,256,974.18              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2018年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2017年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>     |                            |                             |
| 短期借款            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债         | -                          | -                           |
| 衍生金融负债          | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       | -                          | -                           |
| 应付证券清算款         | 95.91                      | 365,462.60                  |
| 应付赎回款           | 3,526,000.12               | 1,861,010.25                |
| 应付管理人报酬         | 451,457.46                 | 575,090.75                  |
| 应付托管费           | 94,053.60                  | 119,810.54                  |
| 应付销售服务费         | -                          | -                           |
| 应付交易费用          | 128,983.56                 | 44,435.31                   |
| 应交税费            | -                          | -                           |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 应付利息          | -              | -              |
| 应付利润          | -              | -              |
| 递延所得税负债       | -              | -              |
| 其他负债          | 370,069.82     | 484,109.14     |
| 负债合计          | 4,570,660.47   | 3,449,918.59   |
| <b>所有者权益:</b> |                |                |
| 实收基金          | 309,066,316.62 | 375,935,938.46 |
| 未分配利润         | 175,520,891.11 | 201,871,117.13 |
| 所有者权益合计       | 484,587,207.73 | 577,807,055.59 |
| 负债和所有者权益总计    | 489,157,868.20 | 581,256,974.18 |

注：(1)报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.202 元，基金份额总额 403,264,362.08 份，其中下属添富恒生份额净值 1.202 元，份额总额 203,083,730.08 份；下属恒生 A 份额净值 1.022 元，份额总额 100,090,316.00 份；下属恒生 B 份额净值 1.382 元，份额总额 100,090,316.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 01 月 01 日 至 2018 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目               | 本期<br>2018 年 01 月 01 日 至 2018 年<br>06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 01 月 01 日 至 2017 年<br>06 月 30 日 |
|-------------------|----------------------------------------------|---------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>       | -14,233,414.21                               | 160,793,975.87                                    |
| 1. 利息收入           | 192,102.68                                   | 366,996.57                                        |
| 其中：存款利息收入         | 192,102.68                                   | 366,996.57                                        |
| 债券利息收入            | -                                            | -                                                 |
| 资产支持证券利息收入        | -                                            | -                                                 |
| 买入返售金融资产收入        | -                                            | -                                                 |
| 其他利息收入            | -                                            | -                                                 |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 44,429,696.53                                | 89,987,006.99                                     |
| 其中：股票投资收益         | 38,657,090.82                                | 35,410,398.68                                     |
| 基金投资收益            | -                                            | -                                                 |
| 债券投资收益            | -                                            | -                                                 |
| 资产支持证券投资          | -                                            | -                                                 |
| 收益                | -                                            | -                                                 |
| 贵金属投资收益           | -                                            | -                                                 |
| 衍生工具收益            | -                                            | 42,555,186.84                                     |
| 股利收益              | 5,772,605.71                                 | 12,021,421.47                                     |

|                            |                       |                       |
|----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | -58,561,295.56        | 74,675,884.81         |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | -949,791.37           | -5,452,650.74         |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 655,873.51            | 1,216,738.24          |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>5,203,910.97</b>   | <b>9,651,085.28</b>   |
| 1. 管理人报酬                   | 3,194,053.80          | 6,387,450.09          |
| 2. 托管费                     | 665,427.82            | 1,330,718.73          |
| 3. 销售服务费                   | -                     | -                     |
| 4. 交易费用                    | 1,003,511.95          | 1,490,862.59          |
| 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                    | 340,917.40            | 442,053.87            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-19,437,325.18</b> | <b>151,142,890.59</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2018年01月01日至2018年06月30日 |                |                 |
|-----------------------------------|-------------------------------|----------------|-----------------|
|                                   | 实收基金                          | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                   | 375,935,938.46                | 201,871,117.13 | 577,807,055.59  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）         | -                             | -19,437,325.18 | -19,437,325.18  |
| 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） | -66,869,621.84                | -6,912,900.84  | -73,782,522.68  |
| 其中：1. 基金申购款                       | 330,663,712.05                | 74,454,264.17  | 405,117,976.22  |
| 2. 基金赎回款                          | -397,533,333.89               | -81,367,165.01 | -478,900,498.90 |
| 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)                        | 309,066,316.62                     | 175,520,891.11 | 484,587,207.73   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年06月30日 |                |                  |
|                                        | 实收基金                               | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 1,400,894,948.39                   | 59,960,430.66  | 1,460,855,379.05 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)              | -                                  | 151,142,890.59 | 151,142,890.59   |
| 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)      | -828,526,853.73                    | -47,835,527.97 | -876,362,381.70  |
| 其中:1.基金申购款                             | 104,221,917.00                     | 8,656,755.92   | 112,878,672.92   |
| 2.基金赎回款                                | -932,748,770.73                    | -56,492,283.89 | -989,241,054.62  |
| 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)                        | 572,368,094.66                     | 163,267,793.28 | 735,635,887.94   |

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

汇添富恒生指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1247号文《关于核准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2014年3月6日正式生效,首次设立募集规模为1,270,631,138.98份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司,境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司(The Hong Kong and Shanghai Banking Co.,Ltd.)。

本基金的份额包括汇添富恒生指数分级证券投资基金之基础份额(简称“添富恒生份额”)、汇添富恒生指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(简称“恒生A份额”)与汇添富恒生指数分级证券投资基金之积极收益类份额(简称“恒生B份额”)。其中,恒生A、恒生B的基金份额配比始终保持1:1的比率不变。本基金的基础份额为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。恒生A份额将具有低风险、收益稳定特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额,类似于债券型基金份额。恒生B份额则具有高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额,类似于具有收益杠杆性的股票型基金份额。

本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标,基金还可投资于债券、基金(包括股票基金、债券基金、交易所交易基金等)、金融衍生工具(包括远期合约、互换、期货、期权、权证等)、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的80%。本基金紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准:经人民币汇率调整的恒生指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率(税后) $\times$ 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 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.6.1 境外投资

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

### 6.4.7 关联方关系

#### 6.4.7.1 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。

#### 6.4.7.2 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 |
| 中国农业银行股份有限公司       | 基金托管人、基金代销机构        |
| 上海汇丰银行有限公司（“汇丰银行”） | 基金境外托管人             |
| 东方证券股份有限公司         | 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。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2018年01月01日至2018年06月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年06月30日 |                  |
|------------|-------------------------------|------------------|------------------------------------|------------------|
|            | 成交金额                          | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额                               | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 东方证券股份有限公司 | 408,699,505.87                | 78.21%           | 398,974,067.63                     | 47.91%           |

##### 6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.8.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

##### 6.4.8.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.8.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2018年01月01日至2018年06月30日 |                   |              |                     |
|------------|-------------------------------|-------------------|--------------|---------------------|
|            | 当期<br>佣金                      | 占当期佣金总<br>量的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 东方证券股份有限公司 | 376,452.90                    | 91.68             | 128,983.56   | 100.00              |

| 关联方名称      | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年06月30日 |                   |              |                     |
|------------|------------------------------------|-------------------|--------------|---------------------|
|            | 当期<br>佣金                           | 占当期佣金总<br>量的比例(%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例(%) |
| 东方证券股份有限公司 | 398,975.60                         | 75.40             | 96,514.15    | 100.00              |

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年01月01日至2018年06月30日 | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年<br>06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,194,053.80                  | 6,387,450.09                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 340,489.43                    | 354,642.08                             |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年01月01日至2018年06月30日 | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年<br>06月30日 |
|----------------|-------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 665,427.82                    | 1,330,718.73                           |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委

托书,于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本报告期内基金管理人及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.8.4.2 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和上年度末未投资本基金。

#### 6.4.8.5 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<br>2018年01月01日至2018年06月30日 |            | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年06月30日 |            |
|--------------------|-------------------------------|------------|------------------------------------|------------|
|                    | 期末余额                          | 当期利息收入     | 期末余额                               | 当期利息收入     |
| 中国农业银行股份有限公司       | 27,933,498.39                 | 165,400.93 | 121,280,071.59                     | 363,584.42 |
| 上海汇丰银行有限公司(“汇丰银行”) | 7,939,626.04                  | 453.15     | 7,760,940.16                       | 2,350.17   |

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国农业银行和境外资产托管人汇丰银行保管,按适用利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 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的证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### **6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### **6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

注: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证券款余额。

#### **6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

注: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证券款余额。

### **6.4.10 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              | 450,999,172.98 | 92.20         |
|    | 其中：普通股            | 450,999,172.98 | 92.20         |
|    | 存托凭证              | -              | -             |
|    | 优先股               | -              | -             |
|    | 房地产信托凭证           | -              | -             |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -              | -             |
|    | 其中：债券             | -              | -             |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
|    | 其中：远期             | -              | -             |
|    | 期货                | -              | -             |
|    | 期权                | -              | -             |
|    | 权证                | -              | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 6  | 货币市场工具            | -              | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 35,908,661.10  | 7.34          |
| 8  | 其他各项资产            | 2,250,034.12   | 0.46          |
| 9  | 合计                | 489,157,868.20 | 100.00        |

注：1、本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 443,448,158.60 人民币，占期末净值比例 91.51%。

2、由于四舍五入的原因市值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|--------|----------------|---------------|
| 香港     | 450,999,172.98 | 93.07         |
| 合计     | 450,999,172.98 | 93.07         |

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别      | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|-----------|---------------|---------------|
| 10 能源     | 29,891,292.69 | 6.17          |
| 15 原材料    | -             | -             |
| 20 工业     | 18,395,266.38 | 3.80          |
| 25 非必需消费品 | 17,418,117.20 | 3.59          |

|    |       |                |       |
|----|-------|----------------|-------|
| 30 | 必需消费品 | 11,150,368.47  | 2.30  |
| 35 | 医疗保健  | 5,434,959.84   | 1.12  |
| 40 | 金融    | 215,483,814.68 | 44.47 |
| 45 | 信息技术  | 55,615,943.04  | 11.48 |
| 50 | 电信服务  | 24,647,269.71  | 5.09  |
| 55 | 公用事业  | 21,570,946.40  | 4.45  |
| 60 | 房地产   | 51,391,194.57  | 10.61 |
| 合计 |       | 450,999,172.98 | 93.07 |

注：1. 以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

2. 由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)                | 公司名称(中文)         | 证券代码    | 所在证券市场  | 所属国家(地区) | 数量(股)        | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------------------------|------------------|---------|---------|----------|--------------|---------------|--------------|
| 1  | TENCENT HOLDINGS LTD    | 腾讯控股有限公司         | 700 HK  | 香港联合交易所 | 香港       | 140,200.00   | 46,548,191.76 | 9.61         |
| 2  | HSBC HOLDINGS PLC       | 汇丰控股有限公司         | 5 HK    | 香港联合交易所 | 香港       | 742,800.00   | 46,092,344.45 | 9.51         |
| 3  | AIA GROUP LTD           | 友邦保险控股有限公司       | 1299 HK | 香港联合交易所 | 香港       | 702,000.00   | 40,601,335.32 | 8.38         |
| 4  | CHINA CONSTRUCTION BANK | 中国建设银行股份有限公司     | 939 HK  | 香港联合交易所 | 香港       | 5,592,000.00 | 34,180,960.20 | 7.05         |
| 5  | IND & COMM BK OF CHINA  | 中国工商银行股份有限公司     | 1398 HK | 香港联合交易所 | 香港       | 4,290,000.00 | 21,231,197.13 | 4.38         |
| 6  | CHINA MOBILE LTD        | 中国移动有限公司         | 941 HK  | 香港联合交易所 | 香港       | 357,000.00   | 20,978,772.99 | 4.33         |
| 7  | PING AN INSURANCE GROUP | 中国平安保险(集团)股份有限公司 | 2318 HK | 香港联合交易所 | 香港       | 303,000.00   | 18,444,161.46 | 3.81         |
| 8  | BANK OF CHINA           | 中国银行             | 3988 HK | 香港联合交易所 | 香港       | 4,619,000.00 | 15,148,744.00 | 3.13         |

|    |                        |                    |        |             |    |                  |                   |      |
|----|------------------------|--------------------|--------|-------------|----|------------------|-------------------|------|
|    | HINA LTD               | 行股份<br>有限公司        | K      | 合交易<br>所    |    | 0.00             | .92               |      |
| 9  | HONG KONG<br>EXCHANGES | 香港交易及<br>结算有限公司    | 388 HK | 香港联<br>合交易所 | 香港 | 68,500.0<br>0    | 13,629,554<br>.60 | 2.81 |
| 10 | CNOOC LTD              | 中国海<br>洋石油有<br>限公司 | 883 HK | 香港联<br>合交易所 | 香港 | 1,038,00<br>0.00 | 11,849,365<br>.81 | 2.45 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 网站的半年度报告正文。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)                          | 证券代码    | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净<br>值比例 (%) |
|----|-----------------------------------|---------|---------------|---------------------|
| 1  | TENCENT HOLDINGS<br>LTD           | 700 HK  | 35,930,216.60 | 6.22                |
| 2  | HSBC HOLDINGS PLC                 | 5 HK    | 26,453,443.07 | 4.58                |
| 3  | CHINA CONSTRUCTION<br>BANK        | 939 HK  | 16,833,425.10 | 2.91                |
| 4  | AIA GROUP LTD                     | 1299 HK | 16,327,922.83 | 2.83                |
| 5  | IND & COMM BK OF<br>CHINA         | 1398 HK | 9,937,251.42  | 1.72                |
| 6  | LINK REIT                         | 823 HK  | 9,260,334.52  | 1.60                |
| 7  | CHINA MOBILE LTD                  | 941 HK  | 9,250,409.21  | 1.60                |
| 8  | PING AN INSURANCE<br>GROUP        | 2318 HK | 8,665,575.01  | 1.50                |
| 9  | BANK OF CHINA LTD                 | 3988 HK | 6,797,949.31  | 1.18                |
| 10 | HONG KONG EXCHANGES               | 388 HK  | 6,299,583.20  | 1.09                |
| 11 | CHINA<br>PHARMACEUTICAL           | 1093 HK | 5,708,093.59  | 0.99                |
| 12 | CK Hutchison Hol<br>dings Limited | 1 HK    | 5,233,871.66  | 0.91                |
| 13 | SUN HUNG KAI<br>PROPERT           | 16 HK   | 4,738,575.66  | 0.82                |
| 14 | CNOOC LTD                         | 883 HK  | 4,427,315.81  | 0.77                |
| 15 | CK ASSET HOLDINGS                 | 1113 HK | 3,572,376.68  | 0.62                |
| 16 | CHINA LIFE<br>INSURANCE           | 2628 HK | 3,558,200.48  | 0.62                |

|    |                                |        |              |      |
|----|--------------------------------|--------|--------------|------|
| 17 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CO. | 386 HK | 3,491,111.93 | 0.60 |
| 18 | GALAXY ENTERTAINMENT           | 27 HK  | 3,051,940.94 | 0.53 |
| 19 | CLP HOLDINGS LTD               | 2 HK   | 2,998,152.56 | 0.52 |
| 20 | HANG SENG BANK LTD             | 11 HK  | 2,930,629.36 | 0.51 |

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

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)                       | 证券代码    | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------------------------------|---------|---------------|----------------|
| 1  | TENCENT HOLDINGS LTD           | 700 HK  | 37,712,324.04 | 6.53           |
| 2  | HSBC HOLDINGS PLC              | 5 HK    | 29,309,862.50 | 5.07           |
| 3  | CHINA CONSTRUCTION BANK        | 939 HK  | 27,212,543.65 | 4.71           |
| 4  | AIA GROUP LTD                  | 1299 HK | 21,570,784.36 | 3.73           |
| 5  | IND & COMM BK OF CHINA         | 1398 HK | 13,082,012.81 | 2.26           |
| 6  | CHINA MOBILE LTD               | 941 HK  | 11,708,836.29 | 2.03           |
| 7  | PING AN INSURANCE GROUP        | 2318 HK | 11,401,343.56 | 1.97           |
| 8  | LINK REIT                      | 823 HK  | 10,351,318.03 | 1.79           |
| 9  | BANK OF CHINA LTD              | 3988 HK | 8,858,029.12  | 1.53           |
| 10 | HONG KONG EXCHANGES            | 388 HK  | 8,095,051.52  | 1.40           |
| 11 | CK Hutchison Holdings Limited  | 1 HK    | 6,779,114.34  | 1.17           |
| 12 | SUN HUNG KAI PROPERT           | 16 HK   | 5,817,852.95  | 1.01           |
| 13 | CNOOC LTD                      | 883 HK  | 5,713,775.84  | 0.99           |
| 14 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CO. | 386 HK  | 4,690,175.18  | 0.81           |
| 15 | CK ASSET HOLDINGS              | 1113 HK | 4,567,297.71  | 0.79           |
| 16 | CHINA LIFE INSURANCE           | 2628 HK | 4,409,986.73  | 0.76           |
| 17 | GALAXY ENTERTAINMENT           | 27 HK   | 4,233,823.33  | 0.73           |
| 18 | CLP HOLDINGS LTD               | 2 HK    | 4,022,898.33  | 0.70           |
| 19 | BOC HONG KONG HOLDINGS         | 2388 HK | 3,841,322.06  | 0.66           |
| 20 | HANG SENG BANK LTD             | 11 HK   | 3,812,883.11  | 0.66           |

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

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

|            |                |
|------------|----------------|
| 买入成本（成交）总额 | 233,294,542.97 |
| 卖出收入（成交）总额 | 289,297,926.41 |

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

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1

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

#### 7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | -            |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | 1,916,175.65 |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 4 | 应收利息  | 7,666.57     |
| 5 | 应收申购款 | 326,191.90   |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 2,250,034.12 |

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级<br>别     | 持有人户<br>数(户) | 户均持有的<br>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<br>例(%) | 持有份额           | 占总份额比<br>例(%) |
| 恒<br>生<br>A      | 343          | 291,808.50    | 85,632,118.00  | 85.55         | 14,458,198.00  | 14.45         |
| 恒<br>生<br>B      | 4,840        | 20,679.82     | 1,977,154.00   | 1.98          | 98,113,162.00  | 98.02         |
| 添<br>富<br>恒<br>生 | 22,591       | 8,989.59      | 46,259,073.40  | 22.78         | 156,824,656.68 | 77.22         |
| 合<br>计           | 27,774       | 14,519.49     | 133,868,345.40 | 33.20         | 269,396,016.68 | 66.80         |

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

恒生 A

| 序号 | 持有人名称                     | 持有份额(份)       | 占上市总份额比例(%) |
|----|---------------------------|---------------|-------------|
| 1  | 中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红   | 42,865,348.00 | 42.83       |
| 2  | 中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品 | 17,571,120.00 | 17.56       |

|    |                             |               |       |
|----|-----------------------------|---------------|-------|
| 3  | 中国银河证券股份有限公司                | 13,226,580.00 | 13.21 |
| 4  | 广发基金-招商银行-招商财富资产管理有限公司      | 5,949,502.00  | 5.94  |
| 5  | 上海均直资产管理有限公司-均直孔最长强私募证券投资基金 | 2,255,245.00  | 2.25  |
| 6  | 金新颜                         | 1,131,291.00  | 1.13  |
| 7  | 陈媚                          | 971,500.00    | 0.97  |
| 8  | 中国国际金融股份有限公司                | 896,200.00    | 0.90  |
| 9  | 苏宁易购集团股份有限公司                | 804,300.00    | 0.80  |
| 10 | 深圳快快资产管理有限公司                | 720,427.00    | 0.72  |

## 恒生 B

| 序号 | 持有人名称                           | 持有份额（份）      | 占上市总份额比例（%） |
|----|---------------------------------|--------------|-------------|
| 1  | 杨继耘                             | 5,501,000.00 | 5.50        |
| 2  | 廖雪静                             | 5,010,000.00 | 5.01        |
| 3  | 李燕欢                             | 1,849,700.00 | 1.85        |
| 4  | 李晓岱                             | 1,772,800.00 | 1.77        |
| 5  | 熊华                              | 1,500,000.00 | 1.50        |
| 6  | 长江证券-招商银行-长江证券超越理财基金管家 II 集合资产管 | 1,350,000.00 | 1.35        |
| 7  | 吴旋玲                             | 1,230,000.00 | 1.23        |
| 8  | 郭峰                              | 1,182,750.00 | 1.18        |
| 9  | 李治国                             | 1,100,000.00 | 1.10        |
| 10 | 王鹏                              | 999,900.00   | 1.00        |

## 添富恒生

| 序号 | 持有人名称                           | 持有份额（份）      | 占上市总份额比例（%） |
|----|---------------------------------|--------------|-------------|
| 1  | 长江证券-招商银行-长江证券超越理财基金管家 II 集合资产管 | 4,440,000.00 | 21.95       |
| 2  | 陈远亮                             | 1,636,918.00 | 8.09        |
| 3  | 中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红         | 1,556,287.00 | 7.69        |
| 4  | 周绍勋                             | 900,152.00   | 4.45        |
| 5  | 徐庆                              | 754,408.00   | 3.73        |
| 6  | 中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品       | 637,946.00   | 3.15        |
| 7  | 周蔓琳                             | 571,400.00   | 2.83        |
| 8  | 张卓君                             | 528,949.00   | 2.62        |
| 9  | 柴庆丰                             | 523,400.00   | 2.59        |
| 10 | 黄葛俊                             | 349,901.00   | 1.73        |

## 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 | 恒生 A | -         | -           |
|        | 恒生 B | -         | -           |

|            |      |            |      |
|------------|------|------------|------|
| 有从业人员持有本基金 | 添富恒生 | 119,344.96 | 0.06 |
|            | 合计   | 119,344.96 | 0.03 |

#### 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 | 恒生 A | 0                 |
|                                | 恒生 B | 0                 |
|                                | 添富恒生 | 0                 |
|                                | 合计   | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 恒生 A | 0                 |
|                                | 恒生 B | 0                 |
|                                | 添富恒生 | 0                 |
|                                | 合计   | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                               | 恒生 A           | 恒生 B           | 添富恒生             |
|----------------------------------|----------------|----------------|------------------|
| 基金合同生效日<br>(2014年3月6日)<br>基金份额总额 | 109,711,438.00 | 109,711,438.00 | 1,051,208,262.98 |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 149,470,400.00 | 149,470,400.00 | 162,854,258.39   |
| 本报告期基金总申购份额                      | —              | —              | 330,663,712.05   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                    | —              | —              | 397,533,333.89   |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）         | -49,380,084.00 | -49,380,084.00 | 107,099,093.53   |
| 本报告期期末基金份额总额                     | 100,090,316.00 | 100,090,316.00 | 203,083,730.08   |

注：总申购份额含红利再投份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

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。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称          | 交易单元数量 | 股票交易            |                 | 应支付该券商的佣金  |               | 备注 |
|---------------|--------|-----------------|-----------------|------------|---------------|----|
|               |        | 成交金额            | 占当期股票成交总额的比例(%) | 佣金         | 占当期佣金总量的比例(%) |    |
| Credit Suisse |        | 113,894,200.24  | 21.79           | 34,168.28  | 8.32          | -  |
| 东方证券          |        | 1408,699,505.87 | 78.21           | 376,452.90 | 91.68         | -  |

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

|                  | 成交<br>金额 | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 (%) | 成交金<br>额 | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 (%) | 成交金<br>额 | 占当期权证<br>成交总额的<br>比例 (%) | 成交金额 | 占当期基金<br>成交总额的<br>比例 (%) |
|------------------|----------|--------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------------|------|--------------------------|
| Credit<br>Suisse | -        | -                        | -        | -                              | -        | -                        | -    | -                        |
| 东方证券             | -        | -                        | -        | -                              | -        | -                        | -    | -                        |

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:

本基金本报告期末新增或退租交易单元。

## § 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。 |
|----|

汇添富基金管理股份有限公司

2018 年 08 月 25 日