# 汇添富保鑫保本混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 ..... 2
1.1 重要提示 ..... 2
1.2 目录 ..... 3
§2 基金简介 ..... 5
2.1 基金基本情况 ..... 5
2.2 基金产品说明 ..... 5
2.3 基金管理人和基金托管人 ..... 5
2.4 信息披露方式 ..... 6
2.5 其他相关资料 ..... 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 ..... 6
3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 6
3.2 基金净值表现 ..... 6
§4 管理人报告 ..... 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 12
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 ..... 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 13
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 ..... 14
§5 托管人报告 ..... 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 14
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 ..... 14
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 ..... 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 14
6.1 资产负债表 ..... 14
6.2 利润表 ..... 16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 ..... 17
6.4 报表附注 ..... 18
§7 投资组合报告 ..... 38
7.1 期末基金资产组合情况 ..... 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 ..... 39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 ..... 41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... 42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... 42

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 ..... 42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 ..... 42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 42
7.12 投资组合报告附注 ..... 42
**§8 基金份额持有人信息 ..... 43**
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 ..... 43
**§9 开放式基金份额变动 ..... 43**
**§10 重大事件揭示 ..... 44**
10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 ..... 44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 44
10.4 基金投资策略的改变 ..... 44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 ..... 44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 44
10.8 其他重大事件 ..... 45
**§11 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 46**
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... 46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 47
**§12 备查文件目录 ..... 47**
12.1 备查文件目录 ..... 47
12.2 存放地点 ..... 47
12.3 查阅方式 ..... 47

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 汇添富保鑫保本混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 汇添富保鑫保本混合 |
| 基金主代码 | 003189 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 9 月 29 日 |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 455,179,474.29 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金主要通过投资组合保险技术来运作，在保证本金安全的前提下，力争在保本期内实现基金财产的稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，利用组合保险技术，动态调整安全资产与风险资产的投资比例，以确保基金在保本周期到期时，实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。安全资产主要包括国债、央行票据、银行存款等品种。风险资产主要包括股票、权证、股指期货等品种。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款收益率（税后）。 |
| 风险收益特征 | 本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 汇添富基金管理股份有限公司 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李鹏 | 胡波 |
| | 联系电话 | 021-28932888 | 021-61618888 |
| | 电子邮箱 | service@99fund.com | Hub5@spdb.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-888-9918 | 95528 |
| 传真 | | 021-28932998 | 021-63602540 |
| 注册地址 | | 上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室 | 上海市中山东一路 12 号 |
| 办公地址 | | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 | 上海市北京东路 689 号 |
| 邮政编码 | | 200120 | 200001 |
| 法定代表人 | | 李文 | 高国富 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.99fund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 汇添富基金管理股份有限公司 | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 层 |
| 基金保证人 | 深圳市高新投集团有限公司 | 深圳市深南大道 7028 号时代科技大厦 22 层、23 层 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 21,657,412.69 |
| 本期利润 | 34,371,506.57 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0753 |
| 本期加权平均净值利润率 | 6.67% |
| 本期基金份额净值增长率 | 7.02% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 62,017,112.02 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1362 |
| 期末基金资产净值 | 527,497,622.26 |
| 期末基金份额净值 | 1.159 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 15.90% |

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

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

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

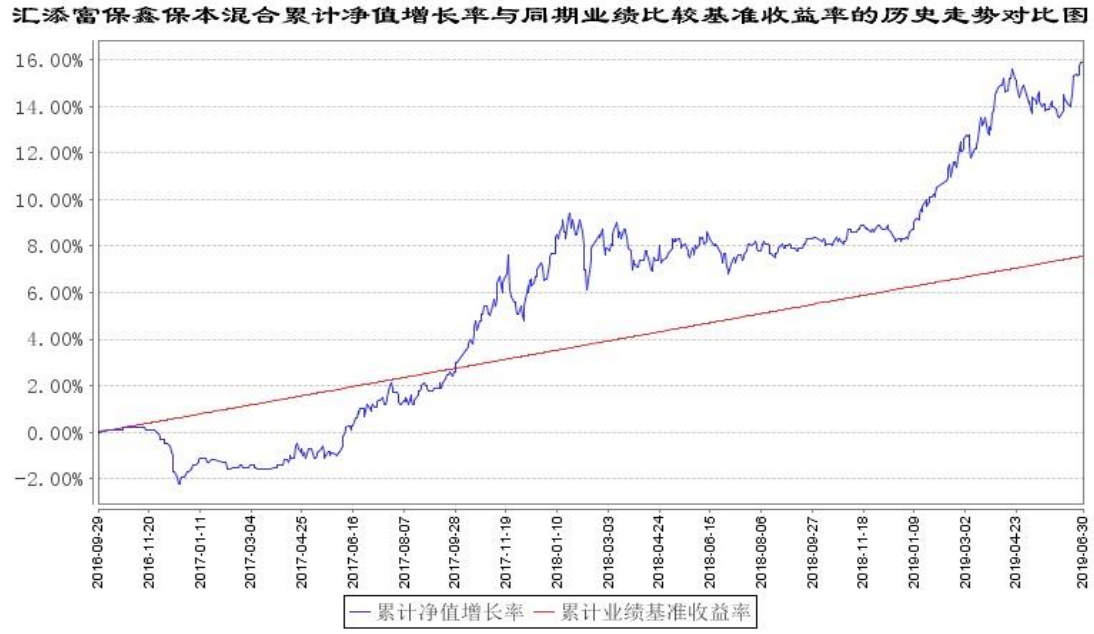
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标 | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|

| | | 准差② | | ④ | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 1.67% | 0.25% | 0.23% | 0.01% | 1.44% | 0.24% |
| 过去三个月 | 1.85% | 0.26% | 0.69% | 0.01% | 1.16% | 0.25% |
| 过去六个月 | 7.02% | 0.26% | 1.36% | 0.01% | 5.66% | 0.25% |
| 过去一年 | 7.61% | 0.20% | 2.75% | 0.01% | 4.86% | 0.19% |
| 自基金合同生效日起至今 | 15.90% | 0.22% | 7.57% | 0.01% | 8.33% | 0.21% |

### 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




注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016 年 9 月 29 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立。目前，公司注册资本金为 132,724,224 元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2019 上半年，汇添富基金新成立 13 只公开募集证券投资基金，包括 5 只债券型基金、4 只混合型基金、2 只基金中基金、2 只指数基金联接基金。截至 2019 年 6 月 30 日，公司共管理 133 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 曾刚 | 汇添富多元收益、可转换债券、实业债债券、双利增强债券、汇添富安鑫智选混合、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富6月红定期开放债券基金、汇添富盈 | 2016年9月29日 | - | 18 | 国籍：中国。学历：中国科技大学学士，清华大学 MBA。业务资格：基金从业资格。从业经历：2008 年 5 月 15 日至 2010 年 2 月 5 日任华富货币基金的基金经理、2008 年 5 月 28 日至 2011 年 11 月 1 日任华富收益增强基金的基金经理、2010 年 9 月 8 日至 2011 年 11 月 1 日任华富强化回报基金的基金经理。2011 年 11 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 安混合（原汇添富盈安保本混合）基金、汇添富盈稳保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富长添利定期开放债券基金、添富年年益定开混合基金、添富熙和混合基金、汇添富达欣混合基金的基金经理，现金管理部总经理。 | | | | 月加入汇添富基金，现任固定收益投资副总监。2012 年 5 月 9 日至 2014 年 1 月 21 日任汇添富理财 30 天基金的基金经理，2012 年 6 月 12 日至 2014 年 1 月 21 日任汇添富理财 60 天基金的基金经理，2012 年 9 月 18 日至今任汇添富多元收益基金的基金经理，2012 年 10 月 18 日至 2014 年 9 月 17 日任汇添富理财 28 天基金的基金经理，2013 年 1 月 24 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富理财 21 天基金的基金经理，2013 年 2 月 7 日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理，2013 年 5 月 29 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富理财 7 天基金的基金经理，2013 年 6 月 14 日至今任汇添富实业债基金的基金经理，2013 年 9 月 12 至 2015 年 3 月 31 日任汇添富现金宝货币基金的基金经理，2013 年 12 月 3 日至今任汇添富双利增强债券基金的基金经理，2015 年 11 月 26 日至今任汇添富安鑫智选混合基金的基金经理，2016 年 2 月 17 日至今任汇添富 6 月红定期开放债券基金的基 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 金经理，2016 年 3 月 16 日至今任汇添富稳健添利定期开放债券基金的基金经理，2016 年 4 月 19 日至今任汇添富盈安混合(原汇添富盈安保本混合)基金的基金经理，2016 年8月3日至今任汇添富盈稳保本混合基金的基金经理，2016年9月29日至今任汇添富保鑫保本混合基金的基金经理，2016 年 12 月 6 日至今任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理，2017年5月15日至今任添富年年益定开混合的基金经理，2018年2月11日至今任添富熙和混合基金的基金经理，2018 年 7 月 6 日至今任汇添富达欣混合基金的基金经理。 |
| 吴江宏 | 汇添富可转换债券基金、汇添富盈安混合（原汇添富盈安保本混合）基金、汇添富盈稳保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富鑫利定开债、汇添富绝对收益定开 | 2016年9月29日 | - | 8 | 国籍：中国，学历：厦门大学经济学硕士。2011 年加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益分析师。2015 年 7 月 17 日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理，2016 年 4 月 19 日至今任汇添富盈安混合(原汇添富盈安保本混合）基金的基金经理，2016 年 8 月 3 日至今任汇添富盈稳保本混合基金的基金经理，2016 年 9 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 混合、汇添富鑫益定开债、添富鑫汇定开债券基金、汇添富民丰回报混合、添富鑫永定开债、添富鑫盛定开债、添富年年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。 | | | | 月 29 日至今任汇添富保鑫保本混合基金的基金经理,2017 年 3 月 13 日至今任汇添富鑫利定开债基金(原添富鑫利债券基金)的基金经理,2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理,2017 年 4 月 20 日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理,2017 年 6 月 23 日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理,2017 年 9 月 27 日至今任汇添富民丰回报混合基金的基金经理,2018 年 1 月 25 日至今任添富鑫永定开债基金的基金经理,2018 年 4 月 16 日至今任添富鑫盛定开债基金的基金经理,2018 年 9 月 28 日至今任添富年年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。 |

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的交易次数为 5 次，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度社融数据好转，显示宽信用政策逐步生效。制造业投资增速下滑，但基建发力、地产投资有韧性，带动固定资产投资增速同比改善。政策托底经济态度明显，央行货币政策保持宽松，更强调逆周期调节和结构性货币政策。

二季度社融总量回落，经济呈现供需两弱。4 月经济数据超预期，政策结束前期的危机模式，货币政策边际收紧，推动债券收益率上行。5 月贸易战出现反复，叠加银行破刚兑事件引发风险偏好回落，货币政策出现边际放松，定向中小行和非银，债券收益率也跟随下行。

上半年债券收益率先上后下，信用债表现好于利率债，以房地产和城投为代表的信用利差出现修复。上半年中债总财富指数上涨 1.5%。

上半年股票市场震荡上行，上证 50 指数上涨 27.80%，沪深 300 指数上涨 27.07%，中证 500 指数上涨 18.77%。

报告期内，组合主要持有短久期高等级信用债，杠杆控制在中低水平。组合在一季度大幅加

仓股票，持仓以低估值蓝筹龙头为主。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.159 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.02%，业绩比较基准收益率为 1.36%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，债市将维持震荡偏强的走势。国内经济呈现供需两弱的格局，经济下行压力仍大，货币政策维持偏松基调的确定性较高，有利于债券收益率下行。海外方面，全球央行加码宽松，国内货币政策空间加大。

经济向下和低利率的环境中，预计股票市场将呈震荡分化格局，贸易战是中期不确定的因素。股票市场投资者结构正发生着深刻变化，外资占比逐步提升，业绩确定性高和持续性强的核心资产，将持续受到市场关注。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：保本周期内：仅采取现金分红一种收益分配方式。转型为“汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金”后，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金

份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期未进行利润分配。

### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇添富保鑫保本混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇添富保鑫保本混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由汇添富基金管理股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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）、投资组合报告等内容真实、准确、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：汇添富保鑫保本混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 42,003,500.23 | 110,450.64 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 结算备付金 | | 4,798,786.88 | 219,555.47 |
| 存出保证金 | | 132,394.99 | 80,253.04 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 544,808,411.57 | 519,593,931.36 |
| 其中：股票投资 | | 76,514,051.85 | 39,714,207.36 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 468,294,359.72 | 479,879,724.00 |
| 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 | | - | 293,177.98 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 6,285,284.00 | 8,210,024.07 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 368,990.04 | 499.70 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 598,397,367.71 | 528,507,892.26 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末<br>2019 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>2018 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 70,000,000.00 | 27,500,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 19,491.12 | - |
| 应付赎回款 | | 109,478.30 | 5,410.00 |
| 应付管理人报酬 | | 342,827.56 | 341,650.38 |
| 应付托管费 | | 42,853.46 | 42,706.30 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 88,826.03 | 475.00 |
| 应交税费 | | 11,447.10 | 12,718.41 |
| 应付利息 | | - | -7,643.83 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 284,821.88 | 330,000.00 |
| 负债合计 | | 70,899,745.45 | 28,225,316.26 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 455,179,474.29 | 461,760,358.00 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 72,318,147.97 | 38,522,218.00 |
| 所有者权益合计 | | 527,497,622.26 | 500,282,576.00 |
| 负债和所有者权益总计 | | 598,397,367.71 | 528,507,892.26 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.159 元，基金份额总额 455,179,474.29 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富保鑫保本混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 37,597,395.06 | 13,615,796.64 |
| 1.利息收入 | | 7,630,397.56 | 12,838,269.61 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 90,548.46 | 135,299.27 |
| 债券利息收入 | | 7,539,849.10 | 12,692,972.35 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 9,997.99 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 17,114,530.65 | 25,344,668.85 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 11,485,272.12 | 25,938,040.53 |
| 基金投资收益 | - | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 4,381,496.71 | -1,793,343.25 |
| 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 | 1,247,761.82 | 1,199,971.57 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 12,714,093.88 | -24,914,612.56 |
| 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 | 138,372.97 | 347,470.74 |
| 减：二、费用 | | 3,225,888.49 | 5,981,659.53 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 2,043,314.15 | 2,998,224.70 |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 255,414.29 | 374,778.10 |
| 3．销售服务费 | | - | - |
| 4．交易费用 | 6.4.7.19 | 360,398.07 | 261,440.15 |
| 5．利息支出 | | 412,876.69 | 2,132,157.04 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 412,876.69 | 2,132,157.04 |
| 6．税金及附加 | | 7,215.29 | 30,849.43 |
| 7．其他费用 | 6.4.7.20 | 146,670.00 | 184,210.11 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 34,371,506.57 | 7,634,137.11 |

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富保鑫保本混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 461,760,358.00 | 38,522,218.00 | 500,282,576.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 34,371,506.57 | 34,371,506.57 |
| 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） | -6,580,883.71 | -575,576.60 | -7,156,460.31 |
| 其中：1.基金申购款 | 17,204,195.41 | 2,410,681.79 | 19,614,877.20 |
| 2.基金赎回款 | -23,785,079.12 | -2,986,258.39 | -26,771,337.51 |
| 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） | 455,179,474.29 | 72,318,147.97 | 527,497,622.26 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>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） | 706,199,394.64 | 46,700,440.27 | 752,899,834.91 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 7,634,137.11 | 7,634,137.11 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -64,217,523.82 | -4,842,289.81 | -69,059,813.63 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| （净值减少以“-”号填列） | | | |
| 其中：1.基金申购款 | 10,278,496.94 | 813,427.70 | 11,091,924.64 |
| 2.基金赎回款 | -74,496,020.76 | -5,655,717.51 | -80,151,738.27 |
| 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） | 641,981,870.82 | 49,492,287.57 | 691,474,158.39 |

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

汇添富保鑫保本混合型证券投资基金 （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[2016]839 号文《关于准予汇添富保鑫保本混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由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 2016 年 9 月 29 日正式生效，首次设立募集规模为 1,160,091,316.65 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(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、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、股票期权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相关规定)。本基金主要通过投资组合保险技术来运作，在保证本金安全的前提下，力争在保本期内实现基金财产的稳健增值。本基金业绩比较基准为：三年期银行定期存款收益率（税后）。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开

放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3　城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4　企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 42,003,500.23 |
| 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 | 42,003,500.23 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 股票 | | 66,339,535.25 | 76,514,051.85 | 10,174,516.60 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 275,224,658.59 | 279,354,359.72 | 4,129,701.13 |
| | 银行间市场 | 188,795,324.92 | 188,940,000.00 | 144,675.08 |
| | 合计 | 464,019,983.51 | 468,294,359.72 | 4,274,376.21 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 530,359,518.76 | 544,808,411.57 | 14,448,892.81 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注:本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注:本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注:本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应收活期存款利息 | 6,863.39 |
| 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 | 2,159.50 |
| 应收债券利息 | 6,276,189.07 |
| 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 | 12.44 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 59.60 |
| 合计 | 6,285,284.00 |

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<br>2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 交易所市场应付交易费用 | 86,776.03 |
| 银行间市场应付交易费用 | 2,050.00 |
| 合计 | 88,826.03 |

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付信息披露费 | 240,190.90 |
| 应付审计费 | 44,630.98 |
| 合计 | 284,821.88 |

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 461,760,358.00 | 461,760,358.00 |
| 本期申购 | 17,204,195.41 | 17,204,195.41 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -23,785,079.12 | -23,785,079.12 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 455,179,474.29 | 455,179,474.29 |

注:申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 40,993,608.17 | -2,471,390.17 | 38,522,218.00 |
| 本期利润 | 21,657,412.69 | 12,714,093.88 | 34,371,506.57 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -633,908.84 | 58,332.24 | -575,576.60 |
| 其中：基金申购款 | 2,018,356.98 | 392,324.81 | 2,410,681.79 |
| 基金赎回款 | -2,652,265.82 | -333,992.57 | -2,986,258.39 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 62,017,112.02 | 10,301,035.95 | 72,318,147.97 |

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 66,877.83 |
| 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 | 22,836.09 |
| 其他 | 834.54 |
| 合计 | 90,548.46 |

注:表中“其他”指直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 113,870,344.42 |
| 减：卖出股票成本总额 | 102,385,072.30 |
| 买卖股票差价收入 | 11,485,272.12 |

### 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|---|---|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 4,381,496.71 |
| 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 | 4,381,496.71 |

### 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|---|---|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 443,217,636.40 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 431,070,535.88 |
| 减：应收利息总额 | 7,765,603.81 |
| 买卖债券差价收入 | 4,381,496.71 |

### 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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,247,761.82 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,247,761.82 |

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 12,714,093.88 |
| 股票投资 | 12,320,298.41 |
| 债券投资 | 393,795.47 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 12,714,093.88 |

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 138,372.97 |
| 合计 | 138,372.97 |

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 358,148.07 |
| 银行间市场交易费用 | 2,250.00 |
| 合计 | 360,398.07 |

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 44,630.98 |
| 信息披露费 | 80,190.90 |
| 账户维护费 | 18,600.00 |
| 银行费用 | 3,248.12 |
| 合计 | 146,670.00 |

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

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

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 汇添富基金管理股份有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |
| 东方证券股份有限公司(“东方证券”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例（%） |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 东方证券股份有限公司 | 240,370,763.20 | 100.00 | 146,602,158.52 | 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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>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（%） | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例（%） |
| 东方证券股份有限公司 | 445,983,640.98 | 100.00 | 293,625,188.05 | 100.00 |

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例（%） |
| 东方证券股份有限公司 | 3,752,800,000.00 | 100.00 | 10,439,200,000.00 | 100.00 |

### 6.4.10.1.4 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 东方证券股份有限公司 | 222,171.66 | 100.00 | 86,776.03 | 100.00 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 东方证券股份有限公司 | 135,147.80 | 100.00 | 69,714.11 | 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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>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 | 2,043,314.15 | 2,998,224.70 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 39,356.12 | 38,371.78 |

注:基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.80%÷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

基金管理费每日计算，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款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、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 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。在保本周期内，本基金的保证费用或风险买断费用从基金管理人的管理费收入中列支。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>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 | 255,414.29 | 374,778.10 |

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

H=E×0.10%/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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。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 2 个

工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 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:本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注:本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 42,003,500.23 | 66,877.83 | 430,455.54 | 48,464.71 |

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

### 6.4.11 利润分配情况

注:本基金本报告期未进行利润分配。

### 6.4.12 期末(2019 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 70,000,000.00 元，于 2019 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 155,158,000.00 | 40,096,000.00 |
| 合计 | 155,158,000.00 | 40,096,000.00 |

注:未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债和超短期融资券。

### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 38,975,000.00 | 78,044,000.00 |
| 合计 | 38,975,000.00 | 78,044,000.00 |

### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| AAA | 243,773,220.77 | 313,070,694.00 |
| AAA 以下 | 20,593,138.95 | 15,981,030.00 |
| 未评级 | 9,795,000.00 | 32,688,000.00 |
| 合计 | 274,161,359.72 | 361,739,724.00 |

注:未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债。

### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注:本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注:本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

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

### 6.4.13.4.1 利率风险

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2019 年 6 月 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 | 42,003,500.23 | | | | | | 42,003,500.23 |
| 结算备付金 | 4,798,786.88 | | | | | | 4,798,786.88 |
| 存出保证金 | 132,394.99 | | | | | | 132,394.99 |
| 交易性金融资产 | 108,953,543.57 | 104,894,368.40 | 224,507,447.75 | 20,144,000.00 | 9,795,000.00 | 76,514,051.85 | 544,808,411.57 |
| 买入返售金融资产 | | | | | | | 0.00 |
| 应收利息 | | | | | | 6,285,284.00 | 6,285,284.00 |
| 应收股利 | | | | | | | 0.00 |
| 应收申购款 | 200,179.89 | | | | | 168,810.15 | 368,990.04 |
| 衍生金融资产 | | | | | | | 0.00 |
| 应收证券清算款 | | | | | | | 0.00 |
| 其他资产 | | | | | | | 0.00 |
| 资产总计 | 156,088,405.56 | 104,894,368.40 | 224,507,447.75 | 20,144,000.00 | 9,795,000.00 | 82,968,146.00 | 598,397,367.71 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | | | | | | 109,478.30 | 109,478.30 |
| 应付管理人报酬 | | | | | | 342,827.56 | 342,827.56 |
| 应付托管 | | | | | | 42,853.46 | 42,853.46 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 费 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | | | | | | 19,491.12 | 19,491.12 |
| 卖出回购金融资产款 | 70,000,000.00 | | | | | | 70,000,000.00 |
| 应付销售服务费 | | | | | | | 0.00 |
| 应付交易费用 | | | | | | 88,826.03 | 88,826.03 |
| 应付税费 | | | | | | 11,447.10 | 11,447.10 |
| 应付利息 | | | | | | | 0.00 |
| 应付利润 | | | | | | | 0.00 |
| 其他负债 | | | | | | 284,821.88 | 284,821.88 |
| 负债总计 | 70,000,000.00 | - | - | - | - | 899,745.45 | 70,899,745.45 |
| 利率敏感度缺口 | 86,088,405.56 | 104,894,368.40 | 224,507,447.75 | 20,144,000.00 | 9,795,000.00 | 82,068,400.55 | 527,497,622.26 |
| 上年度末 2018 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 110,450.64 | - | - | - | - | - | 110,450.64 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 结算备付金 | 219,555.47 | - | - | - | - | - | 219,555.47 |
| 存出保证金 | 80,253.04 | - | - | - | - | - | 80,253.04 |
| 交易性金融资产 | 48,828,306.40 | 19,956,000.00 | 317,939,417.60 | 60,468,000.00 | 32,688,000.00 | 39,714,207.36 | 519,593,931.36 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 8,210,024.07 | 8,210,024.07 |
| 应收申购款 | 199.88 | - | - | - | - | 299.82 | 499.70 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 293,177.98 | 293,177.98 |
| 资产总计 | 49,238,765.43 | 19,956,000.00 | 317,939,417.60 | 60,468,000.00 | 32,688,000.00 | 48,217,709.23 | 528,507,892.26 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 5,410.00 | 5,410.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 341,650.38 | 341,650.38 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 42,706.30 | 42,706.30 |
| 卖出回购金融资产款 | 27,500,000.00 | - | - | - | - | - | 27,500,000.00 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 475.00 | 475.00 |
| 应付税费 | - | - | - | - | - | 12,718.41 | 12,718.41 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | -7,643.83 | -7,643.83 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 330,000.00 | 330,000.00 |
| 负债总计 | 27,500,000.00 | - | - | - | - | 725,316.26 | 28,225,316.26 |
| 利率敏感度缺口 | 21,738,765.43 | 19,956,000.00 | 317,939,417.60 | 60,468,000.00 | 32,688,000.00 | 47,492,392.97 | 500,282,576.00 |

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

| | | | |
|---|---|---|---|
| 假设 | 1.该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； | | |
| | 2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； | | |
| | 3.该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； | | |
| | 4.银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； | | |
| | 5.该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券与可交换债券。 | | |
| | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2019 年 6 月 30 日） | 上年度末（2018 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 基准利率增加 25 个基点 | -616,827.83 | -1,149,094.98 |
| | 基准利率减少 25 个基点 | 622,910.30 | 1,164,458.51 |

### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>2018年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产-股票投资 | 76,514,051.85 | 14.51 | 39,714,207.36 | 7.94 |
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－债券投资 | 468,294,359.72 | 88.78 | 479,879,724.00 | 95.92 |
| 交易性金融资产－贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 544,808,411.57 | 103.29 | 519,593,931.36 | 103.86 |

注:本基金权益类资产占基金资产的比例不高于 40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表。

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | |
|---|---|---|
| 假设 | 1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； | |
| | 2.以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。 | |
| | 相关风险变量的变 | 对资产负债表日基金资产净值的 |

| | 动 | 影响金额（单位：人民币元） | |
|---|---|---|---|
| | | 本期末 （2019 年 6 月 30 日） | 上年度末 （2018 年 12 月 31 日 ） |
| 分析 | 沪深 300 指数上涨 5% | 2,853,020.94 | 2,969,700.84 |
| | 沪深 300 指数下跌 5% | -2,853,020.94 | -2,969,700.84 |

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

### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 76,514,051.85 | 12.79 |
| | 其中：股票 | 76,514,051.85 | 12.79 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 468,294,359.72 | 78.26 |
| | 其中：债券 | 468,294,359.72 | 78.26 |
| | 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 | 46,802,287.11 | 7.82 |
| 8 | 其他各项资产 | 6,786,669.03 | 1.13 |
| 9 | 合计 | 598,397,367.71 | 100.00 |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 38,668,825.55 | 7.33 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,695,948.94 | 1.27 |
| H | 住宿和餐饮业 | 1,796,777.36 | 0.34 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 27,579,500.00 | 5.23 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,773,000.00 | 0.34 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 76,514,051.85 | 14.51 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 250,000 | 22,152,500.00 | 4.20 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 10,000 | 9,840,000.00 | 1.87 |
| 3 | 600309 | 万华化学 | 180,000 | 7,702,200.00 | 1.46 |
| 4 | 600009 | 上海机场 | 79,923 | 6,695,948.94 | 1.27 |
| 5 | 600660 | 福耀玻璃 | 250,000 | 5,682,500.00 | 1.08 |
| 6 | 600872 | 中炬高新 | 100,000 | 4,283,000.00 | 0.81 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 100,000 | 3,598,000.00 | 0.68 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 100,000 | 3,341,000.00 | 0.63 |
| 9 | 000651 | 格力电器 | 50,000 | 2,750,000.00 | 0.52 |
| 10 | 000786 | 北新建材 | 150,000 | 2,719,500.00 | 0.52 |
| 11 | 000858 | 五 粮 液 | 19,929 | 2,350,625.55 | 0.45 |
| 12 | 601166 | 兴业银行 | 100,000 | 1,829,000.00 | 0.35 |
| 13 | 600258 | 首旅酒店 | 99,932 | 1,796,777.36 | 0.34 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 14 | 601888 | 中国国旅 | 20,000 | 1,773,000.00 | 0.34 |

## 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 | 600309 | 万华化学 | 11,872,693.60 | 2.37 |
| 2 | 600048 | 保利地产 | 11,556,142.00 | 2.31 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 10,871,288.00 | 2.17 |
| 4 | 000786 | 北新建材 | 9,136,867.00 | 1.83 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 8,940,262.00 | 1.79 |
| 6 | 600004 | 白云机场 | 8,766,264.00 | 1.75 |
| 7 | 000651 | 格力电器 | 7,821,753.36 | 1.56 |
| 8 | 601318 | 中国平安 | 7,283,142.00 | 1.46 |
| 9 | 600660 | 福耀玻璃 | 6,260,257.00 | 1.25 |
| 10 | 600009 | 上海机场 | 6,127,437.95 | 1.22 |
| 11 | 000858 | 五 粮 液 | 5,476,738.55 | 1.09 |
| 12 | 000333 | 美的集团 | 5,159,106.00 | 1.03 |
| 13 | 000001 | 平安银行 | 4,081,999.00 | 0.82 |
| 14 | 600036 | 招商银行 | 3,542,800.00 | 0.71 |
| 15 | 002475 | 立讯精密 | 3,481,000.00 | 0.70 |
| 16 | 600872 | 中炬高新 | 3,064,894.32 | 0.61 |
| 17 | 601888 | 中国国旅 | 2,994,773.00 | 0.60 |
| 18 | 600887 | 伊利股份 | 2,789,991.00 | 0.56 |
| 19 | 600104 | 上汽集团 | 2,529,479.00 | 0.51 |
| 20 | 600258 | 首旅酒店 | 1,751,798.00 | 0.35 |

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 | 000651 | 格力电器 | 15,788,687.92 | 3.16 |
| 2 | 600048 | 保利地产 | 11,960,916.80 | 2.39 |
| 3 | 600004 | 白云机场 | 9,885,508.00 | 1.98 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 9,318,737.00 | 1.86 |
| 5 | 600309 | 万华化学 | 9,232,430.60 | 1.85 |
| 6 | 600872 | 中炬高新 | 6,485,113.76 | 1.30 |
| 7 | 000786 | 北新建材 | 5,988,075.00 | 1.20 |
| 8 | 002475 | 立讯精密 | 5,252,952.70 | 1.05 |
| 9 | 002127 | 南极电商 | 5,208,179.27 | 1.04 |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 5,174,758.29 | 1.03 |
| 11 | 000001 | 平安银行 | 5,080,338.00 | 1.02 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 12 | 600276 | 恒瑞医药 | 4,532,042.76 | 0.91 |
| 13 | 601933 | 永辉超市 | 4,302,889.00 | 0.86 |
| 14 | 601318 | 中国平安 | 3,625,826.00 | 0.72 |
| 15 | 000858 | 五 粮 液 | 3,353,259.00 | 0.67 |
| 16 | 600104 | 上汽集团 | 2,555,050.00 | 0.51 |
| 17 | 601888 | 中国国旅 | 2,534,491.00 | 0.51 |
| 18 | 000538 | 云南白药 | 1,724,200.00 | 0.34 |
| 19 | 600030 | 中信证券 | 1,510,900.00 | 0.30 |
| 20 | 601233 | 桐昆股份 | 355,989.32 | 0.07 |

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 | 126,864,618.38 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 113,870,344.42 |

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 14,988,000.00 | 2.84 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 109,948,000.00 | 20.84 |
| | 其中：政策性金融债 | 39,804,000.00 | 7.55 |
| 4 | 企业债券 | 140,739,000.00 | 26.68 |
| 5 | 企业短期融资券 | 110,161,000.00 | 20.88 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 53,483,359.72 | 10.14 |
| 8 | 同业存单 | 38,975,000.00 | 7.39 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 468,294,359.72 | 88.78 |

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 143079 | 17 信投 G1 | 400,000 | 40,400,000.00 | 7.66 |
| 2 | 136873 | 16 华泰 G3 | 400,000 | 40,144,000.00 | 7.61 |
| 3 | 011900723 | 19 深航空 SCP008 | 300,000 | 30,087,000.00 | 5.70 |
| 4 | 011901119 | 19 宁沪高 SCP004 | 300,000 | 30,036,000.00 | 5.69 |
| 5 | 011900860 | 19 中电投 | 300,000 | 30,018,000.00 | 5.69 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | SCP013 | | | |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 132,394.99 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,285,284.00 |
| 5 | 应收申购款 | 368,990.04 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,786,669.03 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113014 | 林洋转债 | 4,785,500.00 | 0.91 |
| 2 | 113020 | 桐昆转债 | 4,004,234.00 | 0.76 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 3 | 113511 | 千禾转债 | 2,579,800.00 | 0.49 |
| 4 | 128028 | 赣锋转债 | 1,114,113.00 | 0.21 |
| 5 | 110045 | 海澜转债 | 987,600.00 | 0.19 |
| 6 | 127005 | 长证转债 | 719,076.00 | 0.14 |
| 7 | 128047 | 光电转债 | 415,075.80 | 0.08 |

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例（%） | 持有份额 | 占总份额比例（%） |
| 1,942 | 234,386.96 | 350,263,500.00 | 76.95 | 104,915,974.29 | 23.05 |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 2,991.47 | 0.00 |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2016 年 9 月 29 日）基金份额总额 | 1,160,091,316.65 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 461,760,358.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 17,204,195.41 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 23,785,079.12 |
| 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 | 455,179,474.29 |

注:总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

# §10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东方证券 | 2 | 240,370,763.20 | 100.00% | 222,171.66 | 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 |
| 东方证券 | 445,983,640.98 | 100.00% | 3,752,800,000.00 | 100.00% | - | - |

注:1、专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内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 2018 年资产净值的公告 | 中证报,证券时报,上证报,公司网站 | 2019-01-01 |
| 2 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下 115 只基金 2018 年第 4 季度报告 | 中证报,上交所,证券时报,上证报,公司网站,深交所,证券日报 | 2019-01-21 |
| 3 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大智慧基金为代销机 | 中证报,证券时报,上证报,公司网站 | 2019-01-26 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 构并参与费率优惠活动的公告 | | |
| 4 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加前海财厚为代销机构并参与费率优惠活动的公告 | 证券时报,公司网站 | 2019-03-22 |
| 5 | 汇添富基金旗下 115 只基金 2018 年年度报告 | 中证报,上交所,证券时报,上证报,公司网站,深交所,证券日报 | 2019-03-26 |
| 6 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告 | 中证报,公司网站 | 2019-04-02 |
| 7 | 汇添富基金旗下 123 只基金 2019 年第 1 季度报告 | 中证报,上交所,证券时报,上证报,公司网站,深交所,证券日报 | 2019-04-20 |
| 8 | 汇添富保鑫保本混合型证券投资基金更新招募说明书（2019 年第 1 号） | 中证报,公司网站 | 2019-04-27 |
| 9 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加西部证券为代销机构的公告 | 上证报,公司网站 | 2019-06-22 |

# §11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比（%） |
| 机构 | 1 | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 100,066,500.00 | 0.00 | 0.00 | 100,066,500.00 | 21.98 |
| | 2 | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 200,134,000.00 | 0.00 | 0.00 | 200,134,000.00 | 43.97 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 1、持有人大会投票权集中的风险<br>当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。<br>2、巨额赎回的风险<br>持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。<br>3、基金规模较小导致的风险<br>持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 | | | | | | | |

4、基金净值大幅波动的风险
持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。
5、提前终止基金合同的风险
持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富保鑫保本混合型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富保鑫保本混合型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富保鑫保本混合型证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富保鑫保本混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

**汇添富基金管理股份有限公司**

**2019 年 8 月 29 日**