

汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

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 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 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	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	34
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	35
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	39

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	41
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	41
7.8 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	41
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	41
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	41
7.11 投资组合报告附注.....	42
§ 8 基金份额持有人信息.....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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的情况	43
§9 开放式基金份额变动.....	43
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件.....	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	汇添富全球互联混合(QDII)
基金主代码	001668
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 1 月 25 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	197,296,955.23 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球移动互联主题相关公司的股票，通过对投资对象的精选和组合管理，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金资产配置策略及股票投资策略适用于境内市场投资、境外市场投资及港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票的投资。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出全球移动互联主题相关公司中商业模式清晰、竞争优势明显、具有长期持续增长模式且估值水平相对合理的上市公司，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。
业绩比较基准	50%*人民币计价的中证海外中国互联网指数收益率+50%*中证移动互联网指数收益率
风险收益特征	本基金为主要投资于全球移动互联主题相关公司股票的混合型基金，属于证券投资基金中高预期风险高预期收益的品种，其预期风险与预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	李文	陈四清

2.4 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	布朗兄弟哈里曼银行
	英文	Brown Brothers Harriman Co.
注册地址		140 Broadway New York
办公地址		140 Broadway New York
邮政编码		NY 10005

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 01 月 01 日-2019 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	5,427,370.51
本期利润	65,535,119.57
加权平均基金份额本期利润	0.2926
本期加权平均净值利润率	19.70%
本期基金份额净值增长率	21.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2019 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	44,206,006.38
期末可供分配基金份额利润	0.2241
期末基金资产净值	315,176,973.60
期末基金份额净值	1.597
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2019 年 06 月 30 日）

基金份额累计净值增长率	59.70%
-------------	--------

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	6.75%	1.02%	7.20%	1.35%	-0.45%	-0.33%
过去三个月	3.37%	1.00%	-4.86%	1.46%	8.23%	-0.46%
过去六个月	21.54%	0.98%	22.34%	1.57%	-0.80%	-0.59%
过去一年	3.63%	1.17%	-11.10%	1.68%	14.73%	-0.51%
自基金合同生效起至今	59.70%	1.01%	7.38%	1.32%	52.32%	-0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富全球互联混合(QDII)累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为自《基金合同》生效之日（2017年1月25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		
杨瑨	汇添富全球互联混合（QDII）基金、汇添富文体娱乐混合基金、添富3年封闭配售混合（LOF）基金、汇添富移动互联股票基金的基金经理	2017年1月25日		9年	国籍：中国。学历：清华大学工学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司，2010年8月至2017年1月担任公司的TMT行业分析师，2017年1月25日至今任汇添富全球互联混合（QDII）基金的基金经理，2018年6月21日至今任汇添富文体娱乐混合基金的基金经理，2018年7月5日至今任添富3年封闭配售混合（LOF）基金的基金经理，2019年1月18日至今任汇添富移动互联股票基金的基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”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

注：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。

4.4 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 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。

4.5 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

2019 年上半年，全球股市表现良好，年初即扭转 18 年 12 月大幅下跌的走势并逐步向好。尽管由于中美局势恶化、华为被列入美国出口管制的“实体清单”等负面因素影响，5 月全球市场大幅下跌，但 6 月又迎来了快速反弹，A 股、美股表现强劲。

全球移动互联基金在投资策略上，继续自下而上寻找全球最为优质的科技资产，以求中长期分享全球科技创新的成长红利。我们一方面进一步挖掘了中美两国科技领域具备潜力由小做大、做强的成长型企业，另一方面也加大对一些具备类“特许经营”(Franchise)资质的优良科技资产的深入研究，以期在目前经济、国际政治环境不确定的情况下，可以有效分散组合风险、增强组合均衡性。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

2019 年上半年，全球移动互联基金上涨 21.5%，同期标普 500 指数上涨 17.4%、道琼斯指数上涨 14%、纳斯达克指数上涨 20.7%、恒生指数上涨 10.4%、上证综指上涨 19.5%、深证成指上涨 26.8%、沪深 300 上涨 27.1%、中小板指上涨 20.8%、创业板指上涨 20.9%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们相信未来 3-5 年，人工智能(AI)、大数据(Big Data)、云计算(Cloud Computing)，即所谓的“ABC”产业将接替移动互联网成为全球科技发展的主要驱动力。此外，我们也看好有潜力进口替代的半导体等关键零部件、具备行业定价权和极强用户粘性的互联网平台/内容、具备全

球竞争力的电子制造与 IT 设备龙头企业。希望在以上的投资脉络中选取行业地位稳固、成长前景明确、有优秀企业治理的标的进行中长期布局。同时，在非风格池中，我们继续配置中国的消费品及现代服务业龙头公司。

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《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

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

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

4.8 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 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，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

本报告期内，中国工商银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇添富全球移动互联

灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 06 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	33,685,570.37	76,892,867.72
结算备付金		26,017.99	26,394.33
存出保证金		17,169.64	399,111.34
交易性金融资产	6.4.7.2	290,443,868.18	266,313,200.43
其中：股票投资		284,778,829.70	258,012,369.93
基金投资		5,553,616.40	8,195,553.02
债券投资		111,422.08	105,277.48
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		—	1,577,442.87

应收利息	6.4.7.5	1,877.90	3,895.21
应收股利		71,801.99	42,505.60
应收申购款		616,916.76	393,558.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		324,863,222.83	345,648,975.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 06 月 30 日	上年度末 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		-	-
应付证券清算款		762,299.14	2,236,181.73
应付赎回款		8,001,048.91	10,586,751.30
应付管理人报酬		460,399.31	524,383.17
应付托管费		89,522.07	101,963.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	36,011.14	12,167.08
应交税费		1.00	27,101.59
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	336,967.66	377,250.56
负债合计		9,686,249.23	13,865,798.80
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	197,296,955.23	252,544,464.36
未分配利润	6.4.7.10	117,880,018.37	79,238,712.78
所有者权益合计		315,176,973.60	331,783,177.14
负债和所有者权益总计		324,863,222.83	345,648,975.94

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.597 元，基金份额总额 197,296,955.23 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日 至 2018 年 06 月 30 日
一、收入		69,576,242.18	27,382,108.35
1. 利息收入		229,007.64	134,060.58

其中：存款利息收入	6.4.7.11	217,200.02	127,783.78
债券利息收入		191.20	67.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,616.42	6,209.74
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,447,223.39	22,341,301.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,818,939.03	21,393,050.45
基金投资收益	6.4.7.13	-414,471.37	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.14.1	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,042,755.73	948,251.02
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	60,107,749.06	5,056,938.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-368,419.61	-643,020.15
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	160,681.70	492,827.58
减：二、费用		4,041,122.61	3,544,658.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,969,610.83	2,534,017.64
2. 托管费	6.4.10.2.2	577,424.35	492,725.65
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	348,223.85	324,296.23
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.67	0.19
7. 其他费用	6.4.7.21	145,862.91	193,618.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		65,535,119.57	23,837,449.87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	252,544,464.36	79,238,712.78	331,783,177.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	65,535,119.57	65,535,119.57
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）	-55,247,509.13	-26,893,813.98	-82,141,323.11
其中：1. 基金申购款	51,124,615.77	25,842,347.65	76,966,963.42
2. 基金赎回款	-106,372,124.90	-52,736,161.63	-159,108,286.53
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）	197,296,955.23	117,880,018.37	315,176,973.60
项目	上年度可比期间		
	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）	197,554,566.38	79,049,954.02	276,604,520.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	23,837,449.87	23,837,449.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	44,137,987.13	27,925,706.49	72,063,693.62
其中：1. 基金申购款	180,011,814.70	90,159,108.91	270,170,923.61
2. 基金赎回款	-135,873,827.57	-62,233,402.42	-198,107,229.99
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）	241,692,553.51	130,813,110.38	372,505,663.89

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

汇添富全球移动互联灵活配置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[2015]1478 号文《关于准予汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的准予注册,并获中国证券监督管理委员会机构部函[2016]2979 号文《关于汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》准予延期募集,由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集,基金合同于 2017 年 1 月 25 日生效,首次设立募集规模为 268,156,205.81 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司,境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)。

本基金可投资于下列金融产品或工具:在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(以下无特别说明,均包括 exchange traded fund, ETF);已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品、结构性投资产品;本基金还可投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具,具体包括:股票(包含中小板、创业板、其他依法上市的股票)、股指期货、权证、债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金;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)。

本基金为对冲外币的汇率风险,可以投资于外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。本基金可以进行证券借贷交易,有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。

本基金主要投资于全球移动互联主题相关公司的股票,通过对投资对象的精选和组合管理,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期稳健增值。本基金业绩比较基准为:50%×人民币计价的中证海外中国互联网指数收益率+50%×中证移动互联网指数收益率。

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 差错更正的说明税项

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，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。

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；

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 06 月 30 日
活期存款	33,685,570.37
定期存款	—
其他存款	—
合计：	33,685,570.37

注：本基金于 2019 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：美元 1,208,775.96 元（折合人民币 8,309,972.09 元），港元 1,922,958.10 元（折合人民币 1,691,549.33 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 06 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		217,990,317.47	284,778,829.70	66,788,512.23
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	107,800.00	111,422.08	3,622.08
	银行间市场	-	-	-
	合计	107,800.00	111,422.08	3,622.08
资产支持证券		-	-	-
基金		9,536,548.68	5,553,616.40	-3,982,932.28
其他		-	-	-
合计		227,634,666.15	290,443,868.18	62,809,202.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	1,721.46
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	11.70
应收债券利息	137.04
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借利息	-
其他	7.70
合计	1,877.90

注：“其他”指交易所结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	36,011.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	36,011.14

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,804.97
应付审计费	44,630.98
应付信息披露费	290,531.71
合计	336,967.66

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	252,544,464.36	252,544,464.36
本期申购	51,124,615.77	51,124,615.77
本期赎回（以“-”号填列）	-106,372,124.90	-106,372,124.90
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	197,296,955.23	197,296,955.23

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	49,701,054.02	29,537,658.76	79,238,712.78
本期利润	5,427,370.51	60,107,749.06	65,535,119.57
本期基金份额交易产生的变动数	-10,922,418.15	-15,971,395.83	-26,893,813.98
其中：基金申购款	10,056,200.05	15,786,147.60	25,842,347.65
基金赎回款	-20,978,618.20	-31,757,543.43	-52,736,161.63
本期已分配利润	-	-	-

本期末	44,206,006.38	73,674,011.99	117,880,018.37
-----	---------------	---------------	----------------

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	214,205.57
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	1,572.75
其他	1,421.70
合计	217,200.02

注：“其他”为直销申购款和交易保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	176,260,094.00
减：卖出股票成本总额	167,441,154.97
买卖股票差价收入	8,818,939.03

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	809,090.58
减：卖出/赎回基金成本总额	1,223,561.95
基金投资收益	-414,471.37

6.4.7.14 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	999,550.33
基金投资产生的股利收益	43,205.40
合计	1,042,755.73

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	60,107,749.06
——股票投资	64,804,418.84
——债券投资	6,144.60
——资产支持证券投资	—
——基金投资	-4,702,814.38
——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	60,107,749.06

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	160,681.70
其他	—
合计	160,681.70

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	348,223.85
银行间市场交易费用	—
合计	348,223.85

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98

信息披露费	90,531.71
银行费用	134.00
其他	10,566.22
合计	145,862.91

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
布朗兄弟哈里曼银行	基金境外托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日 至 2019年6月30日		上年度可比期间 2018年01月01日 至 2018年06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	103,205,665.57	33.76%	139,825,084.25	37.92%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日 至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年01月01日 至 2018年06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	-	-%	107,800.00	100.00%

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日 至 2019年6月30日		上年度可比期间 2018年01月01日 至 2018年06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	28,000,000.00	100.00%	100,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	91,474.77	43.22	36,011.14	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日 至 2018年06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	129,778.21	59.97	68,682.39	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日 至 2018 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,969,610.83	2,534,017.64
其中：支付销售机构的客户维护费	861,717.79	721,566.74

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 01 月 01 日 至 2018 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	577,424.35	492,725.65

注：本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.35%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用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 2019年1月1日 至 2019年6月30日		上年度可比期间 2018年01月01日 至 2018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
中国工商银行股份有限公司	23,685,415.55	28,209.40	70,573,155.60	43,545.78
布朗兄弟哈里曼银行	10,000,154.82	185,996.17	4,530,775.20	78,638.10

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管,按适用利率计息。

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直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注:本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况

注:本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末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的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注:本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

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。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。此外，基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

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，基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交

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

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，本报告期末本基金的资产均能及时变现。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、结算备付金、存出保证金、债券投资及部分应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年06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	31,994,378.30	-	-	-	-	1,691,192.07	33,685,570.37
备付金	26,017.99	-	-	-	-	-	26,017.99
存出保证金	17,169.64	-	-	-	-	-	17,169.64
交易性金融资产	111,422.08	-	-	-	-	290,332,446.10	290,443,868.18
应收股利	-	-	-	-	-	71,801.99	71,801.99
应收利息	-	-	-	-	-	1,877.90	1,877.90
应收申购款	-	-	-	-	-	616,916.76	616,916.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清	-	-	-	-	-	-	-

算款							
应收买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	32,148,988.01	-	-	-	-	292,714,234.82	324,863,222.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,001,048.91	8,001,048.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	460,399.31	460,399.31
应付托管费	-	-	-	-	-	89,522.07	89,522.07
应付证券清算款	-	-	-	-	-	762,299.14	762,299.14
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	36,011.14	36,011.14
应交税费	-	-	-	-	-	1.00	1.00
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	336,967.66	336,967.66
负债总计	-	-	-	-	-	9,686,249.23	9,686,249.23
利率敏感度缺口	32,148,988.01	-	-	-	-	283,027,985.59	315,176,973.60
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	71,226,714.68	-	-	-	-	5,666,153.04	76,892,867.72
备付金	26,394.33	-	-	-	-	-	26,394.33
存出保证金	399,111.34	-	-	-	-	-	399,111.34
交易性金融资产	105,277.48	-	-	-	-	266,207,922.95	266,313,200.43
应收股利	-	-	-	-	-	42,505.60	42,505.60
应收利息	-	-	-	-	-	3,895.21	3,895.21
应收申购款	-	-	-	-	-	393,558.44	393,558.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,577,442.87	1,577,442.87
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	71,757,497.83	-	-	-	-	273,891,478.11	345,648,975.94
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	10,586,751.30	10,586,751.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	524,383.17	524,383.17
应付托管费	-	-	-	-	-	101,963.37	101,963.37
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,236,181.73	2,236,181.73
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	12,167.08	12,167.08
应交税费	-	-	-	-	-	27,101.59	27,101.59
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	377,250.56	377,250.56
负债总计	-	-	-	-	-	13,865,798.80	13,865,798.80
利率敏感度缺口	71,757,497.83	-	-	-	-	260,025,679.31	331,783,177.14

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：基金持有的可转债的市场风险在附注 6.4.13.4.3.2 中进行披露；除此之外，本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金及存出保证金，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 06 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				

银行存款	8,309,972.09	1,691,549.33	-	10,001,521.42
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	194,496,864.50	38,237,148.86	-	232,734,013.36
应收股利	34,522.00	37,279.99	-	71,801.99
应收利息	15.26	-	-	15.26
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	202,841,373.85	39,965,978.18	-	242,807,352.03
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	202,841,373.85	39,965,978.18	-	242,807,352.03
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	36,417,387.13	5,666,507.75	-	42,083,894.88
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	157,302,215.57	43,078,443.10	-	200,380,658.67
应收股利	41,594.35	911.25	-	42,505.60
应收利息	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-

应收证券清算款	-	1,577,442.87	-	1,577,442.87
其它资产	-	-	-	-
资产合计	193,761,197.05	50,323,304.97	-	244,084,502.02
以外币计价的负债				
应付证券清算款	2,236,175.37	-	-	2,236,175.37
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
负债合计	2,236,175.37	-	-	2,236,175.37
资产负债表外汇风险敞口净额	191,525,021.68	50,323,304.97	-	241,848,326.65

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑管理人人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
	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 06 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
分析	港币相对人民币升值 5%	1,998,298.91	2,516,165.25
	港币相对人民币贬值 5%	-1,998,298.91	-2,516,165.25
	美元相对人民币升值 5%	10,142,068.69	8,529,906.91
	美元相对人民币贬值 5%	-10,142,068.69	-8,529,906.91

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 06 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	284,778,829.70	90.36	258,012,369.93	77.77
交易性金融资产—基金投资	5,553,616.40	1.76	8,195,553.02	2.47
交易性金融资产—债券投资	111,422.08	0.04	105,277.48	0.03
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	290,443,868.18	92.15	266,313,200.43	80.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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； 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 06 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
分析	比较基准上涨 5%	8,338,524.30	9,049,510.63
	比较基准下跌 5%	-8,338,524.30	-9,049,510.63

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	284,778,829.70	87.66
	其中：普通股	283,045,408.47	87.13
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	1,733,421.23	0.53
2	基金投资	5,553,616.40	1.71
3	固定收益投资	111,422.08	0.03
	其中：债券	111,422.08	0.03
	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	33,711,588.36	10.38
8	其他各项资产	707,766.29	0.22
9	合计	324,863,222.83	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 25,637,874.24 人民币，占期末净值比例 11.18%。

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 (%)
美国	188,943,248.10	59.95
中国	57,598,432.74	18.27
香港	38,237,148.86	12.13
合计	284,778,829.70	90.36

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	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	6,505,018.88	2.06
25 非必需消费品	81,809,169.36	25.96

30 必需消费品	22,389,063.00	7.10
35 医疗保健	3,751,800.00	1.19
40 金融	5,686,944.57	1.80
45 信息技术	163,879,446.63	52.00
50 电信服务	757,387.26	0.24
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	284,778,829.70	90.36

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所有权益投资明细

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	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	22,950.00	21,135,453.94	6.71
2	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	纽约证券交易所	美国	17,000.00	19,803,604.56	6.28
3	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	1,195.00	15,556,675.10	4.94
4	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	香港	39,000.00	12,096,556.53	3.84
5	New Oriental Education & Technology Group Inc.	新东方教育科技集团	EDU US	纽约证券交易所	美国	16,300.00	10,822,523.97	3.43
6	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co., Ltd.	内蒙古伊利实业集团股份有限公司	600887 SH	上海证券交易所	中国	282,600.00	9,441,666.00	3.00
7	VISA INC.	VISA 公司	V US	纽约证券交易所	美国	7,815.00	9,324,109.21	2.96
8	TAL Education Group	好未来教育集团	TAL US	纽约证券交易所	美国	35,350.00	9,259,086.57	2.94

9	Facebook Inc	Facebook Inc	FB US	纳斯达克交易所	美国	6,700.00	8,889,674.57	2.82
10	Kweichow Moutai Co., Ltd.	贵州茅台酒股份有限公司	600519 SH	上海证券交易所	中国	8,000.00	7,872,000.00	2.50
11	AUTODESK INC	欧特克有限公司	ADSK US	纳斯达克交易所	美国	6,600.00	7,391,264.96	2.35
12	Glodon Company Limited	广联达科技股份有限公司	002410 SZ	深圳证券交易所	中国	212,536.00	6,990,309.04	2.22
13	Inspur International Limited	浪潮国际有限公司	596 HK	香港联合交易所	香港	1,900,000.00	6,367,858.74	2.02
14	China International Travel Service Corporation Limited	中国国旅股份有限公司	601888 SH	上海证券交易所	中国	71,665.00	6,353,102.25	2.02
15	ServiceNow, Inc.	ServiceNow, Inc.	NOW US	纽约证券交易所	美国	3,000.00	5,662,759.14	1.80
16	Shanghai Weaver Network Co., Ltd.	上海泛微网络科技有限公司	603039 SH	上海证券交易所	中国	72,354.00	5,368,666.80	1.70
17	Adobe Inc	奥多比公司	ADBE US	纳斯达克交易所	美国	2,610.00	5,286,895.23	1.68
18	SALESFORCE.COM INC	赛富时公司	CRM US	纽约证券交易所	美国	4,800.00	5,006,871.51	1.59
19	PayPal Holdings, Inc.	PayPal Holdings, Inc.	PYPL US	纳斯达克交易所	美国	6,101.00	4,800,743.67	1.52
20	Beijing Career International Co., Ltd.	北京科锐国际人力资源股份有限公司	300662 SZ	深圳证券交易所	中国	115,000.00	4,073,300.00	1.29
21	Keysight Technologies, Inc.	是德科技公司	KEYS US	纽约证券交易所	美国	6,500.00	4,013,209.25	1.27
22	Luxshare Precision Industry Co., Ltd.	立讯精密工业股份有限公司	002475 SZ	深圳证券交易所	中国	160,000.00	3,966,400.00	1.26
23	Tianli Education International Holdings Limited	天立教育国际控股有限公司	1773 HK	香港联合交易所	香港	1,300,000.00	3,933,839.52	1.25
24	Pinduoduo Inc	拼多多	PDD US	纳斯达克交易所	美国	27,500.00	3,900,189.00	1.24

4	c.					00	18	
25	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行股份有限公司	3968 HK	香港联合交易所	香港	110,000.00	3,768,903.27	1.20
26	Changchun High & New Technology Industries (Group) Inc.	长春高新技术产业(集团)股份有限公司	000661 SZ	深圳证券交易所	中国	11,100.00	3,751,800.00	1.19
27	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	金蝶国际软件集团有限公司	268 HK	香港联合交易所	香港	495,000.00	3,679,397.87	1.17
28	TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	TAKE-TWO 互动软件公司	TTWO US	纳斯达克交易所	美国	4,500.00	3,512,181.11	1.11
29	Alphabet Inc.	谷歌(Alphabet)	GOOGL US	纳斯达克交易所	美国	455.00	3,386,985.95	1.07
30	Ganso Co., Ltd.	上海元祖梦果子股份有限公司	603886 SH	上海证券交易所	中国	120,800.00	3,199,992.00	1.02
31	Fu Shou Yuan International Group Limited	福寿园国际集团有限公司	1448 HK	香港联合交易所	香港	527,000.00	3,175,528.62	1.01
32	NetEase, Inc	网易公司	NTES US	纳斯达克交易所	美国	1,800.00	3,165,015.63	1.00
33	JD.com, Inc.	京东商城电子商务有限公司	JD US	纳斯达克交易所	美国	14,500.00	3,019,402.61	0.96
34	Baozun Inc.	宝尊电商	BZUN US	纳斯达克交易所	美国	8,600.00	2,947,843.86	0.94
35	Ninestar Corporation	纳思达股份有限公司	002180 SZ	深圳证券交易所	中国	128,841.00	2,911,806.60	0.92
36	UNIVERSAL DISPLAY CORP	UNIVERSAL DISPLAY CORP	OLED US	纳斯达克交易所	美国	2,200.00	2,844,283.38	0.90
37	VMware Inc	威睿公司	VMW US	纽约证券交易所	美国	2,450.00	2,816,320.54	0.89
38	Bilibili Inc.	哔哩哔哩	BILI US	纳斯达克交易所	美国	24,000.00	2,684,432.86	0.85
39	Meituan Dianping	美团点评	3690 HK	香港联合交易所	香港	43,000.00	2,591,038.53	0.82
40	ADVANCED MICRO DEVICES INC	美国超威半导体公司	AMD US	纳斯达克交易所	美国	12,000.00	2,505,415.67	0.79
4	ZTO Express	中通快递	ZTO US	纽约证券交易所	美国	18,500.	2,431,718.	0.77

1	(Cayman) Inc.					00	88	
42	YY Inc.	欢聚时代科技有限公司	YY US	纳斯达克交易所	美国	5,000.00	2,395,489.22	0.76
43	Twitter Inc	推特公司	TWTR US	纽约证券交易所	美国	8,700.00	2,087,365.16	0.66
44	CTRIPTrip.com International Ltd	携程国际有限公司	CTRP US	纳斯达克交易所	美国	8,100.00	2,055,335.93	0.65
45	LexinFintech Holdings Ltd.	深圳乐信控股有限公司	LX US	纳斯达克交易所	美国	25,000.00	1,918,041.30	0.61
46	CISCO SYSTEMS, INC.	思科	CSCO US	纳斯达克交易所	美国	5,000.00	1,881,261.66	0.60
47	Wuliangye Yibin Co.,Ltd	宜宾五粮液股份有限公司	000858SZ	深圳证券交易所	中国	15,900.00	1,875,405.00	0.60
48	Huya Inc.	虎牙直播	HUYA US	纽约证券交易所	美国	11,000.00	1,868,612.21	0.59
49	SQUARE, INC.	SQUARE, INC.	SQ US	纽约证券交易所	美国	3,700.00	1,844,901.37	0.59
50	Activision Blizzard, Inc.	动视暴雪股份有限公司	ATVI US	纳斯达克交易所	美国	5,600.00	1,817,120.70	0.58
51	B-Soft Co.,Ltd.	创业软件股份有限公司	300451SZ	深圳证券交易所	中国	119,999.00	1,793,985.05	0.57
52	CyberArk Software Ltd.	CyberArk Software Ltd.	CYBR US	纳斯达克交易所	美国	2,000.00	1,757,723.30	0.56
53	Equinix Inc	易昆尼克斯公司	EQIX US	纳斯达克交易所	美国	500.00	1,733,421.23	0.55
54	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	自动数据处理公司	ADP US	纳斯达克交易所	美国	1,500.00	1,704,891.23	0.54
55	Acacia Communications, Inc.	Acacia 通讯公司	ACIA US	纳斯达克交易所	美国	5,000.00	1,621,054.26	0.51
56	ACM Research, Inc.	ACM Research, Inc.	ACMR US	纳斯达克交易所	美国	13,000.00	1,395,082.87	0.44
57	Mellanox Technologies Ltd	迈勒罗斯科技公司	MLNX US	纳斯达克交易所	美国	1,800.00	1,369,481.49	0.43
58	Momo Inc.	陌陌公司	MOMO US	纳斯达克交易所	美国	5,000.00	1,230,571.30	0.39
59	TABLEAU SOFTWARE INC	TABLEAU SOFTWARE INC	DATA US	纽约证券交易所	美国	1,000.00	1,141,337.69	0.36

60	So-Young International Inc.	新氧	SY US	纳斯达克交易所	美国	10,000.00	954,895.83	0.30
61	Maoyan Entertainment	猫眼娱乐	1896 HK	香港联合交易所	香港	75,000.00	849,751.56	0.27
62	China Tower Corporation Limited	中国铁塔股份有限公司	788 HK	香港联合交易所	香港	420,000.00	757,387.26	0.24
63	AsiaInfo Technologies Limited	亚信科技有限公司	1675 HK	香港联合交易所	香港	80,000.00	527,796.00	0.17
64	China East Education Holdings Limited	中国东方教育控股有限公司	667 HK	香港联合交易所	香港	50,000.00	489,090.96	0.16

注：本表所使用的境外证券代码为彭博代码。

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	占期初基金资产净值比例(%)
1	Inspur International Limited	596 HK	6,946,150.96	2.09
2	iQIYI, Inc.	IQ US	5,610,919.41	1.69
3	China Automotive Engineering Research Institute Co., Ltd	601965 SH	4,794,303.97	1.45
4	SQUARE, INC.	SQ US	4,278,442.81	1.29
5	Maoyan Entertainment	1896 HK	4,242,412.92	1.28
6	Meituan Dianping	3690 HK	3,966,542.90	1.20
7	JD.com, Inc.	JD US	3,847,356.35	1.16
8	Acacia Communications, Inc.	ACIA US	3,676,933.99	1.11
9	Chacha Food Company, Limited	002557 SZ	3,340,187.00	1.01
10	Keysight Technologies, Inc.	KEYS US	3,221,590.51	0.97
11	YY Inc.	YY US	3,212,176.47	0.97
12	TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	TTWO US	3,199,211.13	0.96
13	Ninestar Corporation	002180 SZ	3,101,149.00	0.93

	on			
14	Bilibili Inc.	BILI US	2,719,759.48	0.82
15	Ganso Co., Ltd.	603886 SH	2,682,792.00	0.81
16	INPHI Corp	IPHI US	2,587,389.36	0.78
17	ZTO Express (Cayman) Inc.	ZTO US	2,406,381.15	0.73
18	CTRI COM INTERNATIONAL LTD	CTRP US	2,398,608.72	0.72
19	AUTODESK INC	ADSK US	2,093,512.49	0.63
20	Mauser Group N.V.	MA US	1,998,556.13	0.60

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	China Tower Corporation Limited	788 HK	8,095,082.65	2.44
2	Shanghai International Airport Co., Ltd.	600009 SH	6,248,949.07	1.88
3	Hangzhou Hikvision Digital Technology Co., Ltd.	002415 SZ	6,014,165.18	1.81
4	iQIYI, Inc.	IQ US	5,971,002.92	1.80
5	Changchun High & New Technology Industries (Group) Inc.	000661 SZ	5,136,670.00	1.55
6	China Automotive Engineering Research Institute Co., Ltd	601965 SH	5,006,627.00	1.51
7	XILINX INC	XLNX US	4,980,440.70	1.50
8	Tencent Holdings Ltd	700 HK	4,918,972.54	1.48
9	Activision Blizzard, Inc.	ATVI US	4,509,001.18	1.36
10	Shennan Circuits Co., Ltd.	002916 SZ	4,324,082.60	1.30
11	China Communications Services Corporation Limited	552 HK	4,294,415.22	1.29
12	Alphabet Inc.	GOOGL US	4,272,815.79	1.29
13	Travelsky Technology Limited	696 HK	3,826,958.18	1.15
14	Fujian Star-Net Communication Co., Ltd.	002396 SZ	3,737,180.00	1.13

15	Chacha Food Company, Limited	002557 SZ	3,734,863.00	1.13
16	VMware Inc	VMW US	3,696,458.90	1.11
17	51JOB, INC.	JOBS US	3,690,936.69	1.11
18	Sony Corp	SNE US	3,667,659.21	1.11
19	NetEase, Inc	NTES US	3,652,160.67	1.10
20	Maoyan Entertainment	1896 HK	3,528,010.98	1.06

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	129,403,195.90
卖出收入（成交）总额	176,260,094.00

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

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
AAA 以下	111,422.08	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128035	大族转债	1,078.00	111,422.08	0.04

7.8 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。

7.9 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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	PROSHARES ULTRAPRO SHORT QQQ	ETF	开放式	ProSharesTrust	4,349,622.69	1.38
2	DIREXION DAILY SEMICON 3X	ETF	开放式	DirexionSharesETFTrust	1,203,993.71	0.38

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	17,169.64
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	71,801.99
4	应收利息	1,877.90
5	应收申购款	616,916.76
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	707,766.29

7.11.4 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	证券代码	证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128035	大族转债	111,422.08	0.04

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

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
17,676	11,161.86	30,608,587.57	15.51	166,688,367.66	84.49

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	4,786,641.83	2.43

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的情况

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	>100
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（2017 年 1 月 25 日）基金份额总额	268,156,205.81
本报告期期初基金份额总额	252,544,464.36
本报告期基金总申购份额	51,124,615.77
减：本报告期基金总赎回份额	106,372,124.90
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	197,296,955.23

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

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	103,205,665.57	33.76	91,474.77	43.22	-
Sanford C. Bernstein & Co.	-	46,173,975.58	15.11	16,912.64	7.99	-
China Merchants Securities	-	708,511.77	0.23	566.81	0.27	-
China International Capital Corporation (Hong Kong)	-	3,309,087.60	1.08	33,090.88	15.63	-
Credit Suisse	-	65,874,762.11	21.55	26,714.78	12.62	-
Haitong International Securities Group Limited	-	494,353.13	0.16	4,943.53	2.34	-
J.P. Morgan	-	60,474,265.43	19.78	26,543.68	12.54	-
Morgan Stanley	-	9,632,961.47	3.15	1,854.70	0.88	-

nley						
Oppenheimer	-	15,789,707.19	5.17	9,547.08	4.51	-
Zhongtai International Securities	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas	-	-	-	-	-	-

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
东方证券	-	-	28,000,000.00	100.00	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein & Co.	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation (Hong Kong)	-	-	-	-	-	-	-	-

Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	2,409,876.03	58.87
Haitong International Securities Group Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan	-	-	-	-	-	-	1,683,654.26	41.13
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
Oppenheimer	-	-	-	-	-	-	-	-
Zhongta International Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas	-	-	-	-	-	-	-	-

注：（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。

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 QDII 基金 2018 年年度资产净值的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-01-03
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构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-01-26
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东莞农商银行作为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-02-01
5	汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2019 年第 1 号)	证券时报, 公司网站	2019-03-01
6	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
7	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
8	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
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加广州农商银行作为代销机构的公告	上证报, 公司网站	2019-05-08
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加西部证券为代销机构的公告	上证报, 公司网站	2019-06-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富全球移动互联灵活配置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、报告期内汇添富全球移动互联灵活配置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 08 月 29 日