

汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 2018年半年度报告摘要

(上接 B698 版)

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 名称, 金额

Table with columns: 序号, 持有人名称, 持有份额(份), 占上市总份额比例

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
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

Table with columns: 券商名称, 交易数量, 成交金额, 占当期股票成交总额的比例, 佣金, 占当期佣金总额的比例

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给该券商的佣金合计,不单独披露交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.3 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.4 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.5 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

Table with columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额

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写,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按股票品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

7.8 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末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。

7.12.5.2 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with columns: 份额类别, 持有人户数(户), 户均持有的基金份额

Table with columns: 基金份额, 持有人名称, 持有份额, 占基金份额比例

8.2 期末上市基金份额前十名持有人

Table with columns: 序号, 持有人名称, 持有份额(份), 占上市总份额比例

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。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with columns: 份额类别, 持有人户数(户), 户均持有的基金份额

Table with columns: 基金份额, 持有人名称, 持有份额, 占基金份额比例

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 项目, 持有基金份额(份), 占基金总份额比例

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金开放式基金的情况

Table with columns: 项目, 持有基金份额(份), 占基金总份额比例

9.1 开放式基金投资组合

Table with columns: 项目, 持有基金份额, 持有份额占基金总份额比例

注:其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额,“总赎回份额”含转换出份额。

10.1 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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

10.4 基金投资策略的改变

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的情况

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

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期股票成交总额的比例, 佣金, 占当期佣金总额的比例

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给该券商的佣金合计,不单独披露交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.3 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.4 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

(上接 B699 版)

注:本项“卖出金额”按卖出成交金额填写,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

Table with columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额

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写,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按股票品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

7.8 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额

Table with columns: 基金份额, 持有人名称, 持有份额, 占基金份额比例

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 项目, 持有基金份额(份), 占基金总份额比例

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金开放式基金的情况

Table with columns: 项目, 持有基金份额(份), 占基金总份额比例

9.1 开放式基金投资组合

Table with columns: 项目, 持有基金份额, 持有份额占基金总份额比例

注:其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额,“总赎回份额”含转换出份额。

10.1 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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

10.4 基金投资策略的改变

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的情况

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

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期股票成交总额的比例, 佣金, 占当期佣金总额的比例

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给该券商的佣金合计,不单独披露交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.3 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所(特准普通合伙)自本基金合同生效后(2018年3月23日)起至本报告期末,为基金提供审计。

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,本基金管理人、基金托管人、基金财产审计师及高级管理人员均未受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的情况

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

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期股票成交总额的比例, 佣金, 占当期佣金总额的比例

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给该券商的佣金合计,不单独披露交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.3 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.4 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.5 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.6 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.7 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.8 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.9 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.10 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.11 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.12 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.13 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.14 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

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协调、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;

10.7.15 基金租用证券公司交易单元执行其他证券投资的概况

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

注: