(上接 B702 版)

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(%) |
|---|---|---|
| A-至A+ | 2,368,505.00 | 3.35 |
| BBB-至BBB+ | 8,005,186.14 | 11.34 |
| BB-至BB+ | 21,528,742.41 | 30.50 |
| B-至B+ | 21,986,783.16 | 31.14 |
| 其他 | 4,324,788.00 | 6.13 |

注:本基金债券投资组合主要采用穆迪、标准普尔等国际权威评级机构提供的债券信用评级信息。

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(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | XS1489734746 HK | UNILIC 3 09/19/21 | 8,000 | 4,887,179.56 | 6.92 |
| 2 | XS1014156274 HK | KWGPRO 8.975 19 | 7,000 | 4,701,603.78 | 6.66 |
| 3 | XS1157365070 HK | SHIMAO 8.375 02/10/22 | 5,000 | 3,494,127.21 | 4.95 |
| 4 | XS1215617272 HK | AGILE 9 05/21/20 | 5,000 | 3,432,758.25 | 4.86 |
| 5 | XS1219965297 SG | CENCHI 8.75 01/21 | 5,000 | 3,352,168.06 | 4.75 |

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注:本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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

7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 2,041.24 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,273,067.22 |
| 5 | 应收申购款 | 1,561,238.14 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,836,346.60 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

## §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例(%) | 持有份额 | 占总份额比例(%) |
| 汇添富美元债券(QDII)人民币A | 976 | 43,597.16 | 2,998,800.48 | 7.05 | 39,552,030.77 | 92.95 |
| 汇添富美元债券(QDII)人民币C | 227 | 106,886.33 | 0.00 | 0.00 | 24,263,196.45 | 100.00 |
| 汇添富美元债券(QDII)美元现汇A | 52 | 10,893.94 | 0.00 | 0.00 | 566,484.65 | 100.00 |
| 汇添富美元债券(QDII)美元现汇C | 47 | 6,218.70 | 0.00 | 0.00 | 292,278.79 | 100.00 |
| 合计 | 1,302 | 51,976.03 | 2,998,800.48 | 4.43 | 64,673,990.66 | 95.57 |

注:表内美元现汇A和美元现汇C的份额以及占比未按汇率进行折算。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例(%) |
|---|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 汇添富美元债券(QDII)人民币A | 151,920.71 | 0.36 |
| | 汇添富美元债券(QDII)人民币C | 1,010.03 | 0.00 |
| | 汇添富美元债券(QDII)美元现汇A | 38,091.16 | 6.72 |
| | 汇添富美元债券(QDII)美元现汇C | 9,850.28 | 3.37 |
| | 合计 | 200,872.18 | 0.30 |

注:上表美元现汇A类份额为美元份额。如果将美元份额按照2018年6月29日中国人民银行美元兑换人民币汇率中间价折算为人民币份额后进行计算,美元现汇A的管理人所有从业人员持有本基金为252,033.97份,美元现汇C的管理人所有从业人员持有本基金为65,175.36份;从业人员持有本基金合计份额为470,140.07份,合计份额占比为0.65%。

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 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|---|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 汇添富美元债券(QDII)人民币A | 0 |
| | 汇添富美元债券(QDII)人民币C | 0 |
| | 汇添富美元债券(QDII)美元现汇A | 0 |
| | 汇添富美元债券(QDII)美元现汇C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 汇添富美元债券(QDII)人民币A | 0 |
| | 汇添富美元债券(QDII)人民币C | 0 |
| | 汇添富美元债券(QDII)美元现汇A | 0 |
| | 汇添富美元债券(QDII)美元现汇C | 0 |
| | 合计 | 0 |

## §9 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 汇添富美元债券(QDII)人民币A | 汇添富美元债券(QDII)人民币C | 汇添富美元债券(QDII)美元现汇A | 汇添富美元债券(QDII)美元现汇C |
|---|---|---|---|---|
| 基金合同生效日(2017年4月20日)基金份额总额 | 225,663,207.09 | 14,404,763.17 | 314,116.45 | 294,201.43 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 152,735,650.46 | 5,477,060.30 | 623,494.15 | 593,297.25 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,767,979.02 | 21,573,058.84 | 15,483.44 | 36,189.64 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 112,952,798.23 | 2,786,922.69 | 72,492.94 | 337,208.10 |
| 本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - | - | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 42,550,831.25 | 24,263,196.45 | 566,484.65 | 292,278.79 |

注:总申购份额含红利再投份额。

## §10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1.(汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金基金合同)于2018年1月19日正式生效,胡昕炜先生任该基金的基金经理.
2.(汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同)于2018年1月25日正式生效,吴江宏先生任该基金的基金经理.
3.(汇添富熙和精选混合型证券投资基金基金合同)于2018年2月11日正式生效,曾刚先生任该基金的基金经理.
4.(汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金基金合同)于2018年2月13日正式生效,陈加荣先生任该基金的基金经理.
5.(汇添富行业整合主题混合型证券投资基金基金合同)于2018年2月13日正式生效,赵鹏程先生任该基金的基金经理.
6.(汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金基金合同)于2018年2月13日正式生效,陈建玮先生和劳杰男先生任该基金的基金经理.
7.基金管理人于2018年2月14日公告,增聘胡娜女士担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理,与陈加荣先生共同管理该基金.
8.基金管理人2018年3月2日公告,劳杰男先生不再担任汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的基金经理,由李威先生单独管理该基金.
9.基金管理人于2018年3月2日公告,增聘邓慧莲女士担任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理,与曾刚先生共同管理该基金.
10.(汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同)于2018年3月8日正式生效,李怀宏先生和陆文磊先生任该基金的基金经理.
11.基金管理人于2018年3月20日公告,增聘赵鹏飞先生担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理,与陈加荣先生、胡娜女士共同管理该基金.
12.(汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同)于2018年3月23日正式生效,吴振翔先生和许一尊先生任该基金的基金经理.
13.基金管理人于2018年4月3日公告,增聘邓慧莲女士担任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,与曾刚先生共同管理该基金.
14.(汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同)于2018年4月16日正式生效,吴江宏先生和胡娜女士任该基金的基金经理.
15.(汇添富智能制造股票型证券投资基金基金合同)于2018年4月23日正式生效,赵鹏飞先生任该基金的基金经理.
16.(汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同)于2018年4月26日正式生效,陈加荣先生任该基金的基金经理.
17.基金管理人于2018年5月5日公告,蒋文玲女士不再担任汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理,增聘徐寅超女士担任该基金的基金经理,由徐寅超女士单独管理该基金.
18.基金管理人于2018年5月5日公告,蒋文玲女士不再担任汇添富理财30天债券型证券投资基金的基金经理,增聘徐寅超女士担任该基金的基金经理,由徐寅超女士单独管理该基金.
19.基金管理人于2018年5月5日公告,蒋文玲女士不再担任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理,增聘徐寅超女士担任该基金的基金经理,由徐寅超女士单独管理该基金.
20.基金管理人于2018年5月5日公告,徐寅超女士不再担任汇添富金鑫宝货币市场基金的基金经理,与蒋文玲女士共同管理该基金.
21.基金管理人于2018年5月5日公告,陆文磊先生和徐寅超女士不再担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理,由陶然先生单独管理该基金.
22.基金管理人于2018年5月5日公告,徐寅超女士不再担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理,增聘陶然先生担任该基金的基金经理,由陶然先生单独管理该基金.
23.基金管理人于2018年5月5日公告,增聘徐寅超女士担任汇添富货币市场基金的基金经理,与蒋文玲女士共同管理该基金.
24.基金管理人2018年5月17日公告,韩贤旺先生和欧阳沁春先生不再担任汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,由杨瑗先生单独管理该基金.
25.(汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金(LOF)基金合同)于2018年5月23日正式生效,过蓉蓉女士任该基金的基金经理.
26.基金管理人2018年5月29日公告,聘任茹奕嘉为汇添富6月红添利定期开放债券型证券投资基金,汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金,汇添富多元收益债券型证券投资基金,汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金,汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金,汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金,汇添富双利增强债券型证券投资基金,汇添富双利债券型证券投资基金,汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理助理,协助上述基金的基金经理开展投资管理工作.
27.(汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金基金合同)于2018年6月21日正式生效,杨瑗先生任该基金的基金经理.
28.报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动.

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人,基金财产的诉讼事项。
本报告期内,无涉及基金托管业务的诉讼事项。

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

注:注:本基金本报告期未租用证券公司交易单元进行股票投资。

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(%) |
| BNP Paribas | 1,898,137.13 | 1.03 | - | - | - | - | - | - |
| Bank of China (Hong Kong) Limited | 25,259,580.40 | 13.68 | - | - | - | - | - | - |
| China International Capital Corporation | 3,179,336.15 | 1.72 | - | - | - | - | - | - |
| CITIC Securities International Company | 34,131,015.23 | 18.48 | - | - | - | - | - | - |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 12,813,292.31 | 6.94 | - | - | - | - | - | - |
| Guotai Junan Securities Company Ltd. | 5,845,786.26 | 3.17 | - | - | - | - | - | - |
| Haitong International Securities Group Limited | 13,837,450.59 | 7.49 | - | - | - | - | - | - |
| Huatai Securities Co., Ltd. | 10,505,004.43 | 5.69 | - | - | - | - | - | - |
| JPMorgan Chase & Co. | 3,348,207.99 | 1.81 | - | - | - | - | - | - |
| KGI Securities Asia | 9,561,109.00 | 5.18 | - | - | - | - | - | - |
| Morgan Stanley | 28,751,392.86 | 15.57 | - | - | - | - | - | - |
| Mizuho Bank Ltd | 3,059,515.84 | 1.66 | - | - | - | - | - | - |
| SC Lowy Financial HK Ltd | 3,184,479.38 | 1.72 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 26,269,103.84 | 14.23 | 5,000,000.00 | 100.00 | - | - | - | - |
| BOC International Holdings Ltd | 3,019,448.45 | 1.64 | - | - | - | - | - | - |

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

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

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

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

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

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

2、报告期内未新增或退租证券公司交易单元。

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金份额情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 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 | 2018年1月1日至2018年4月8日 | 99,859,197.12 | 0.00 | 99,859,197.12 | 0.00 | 0.00 |
| 个人 | 1 | 2018年6月27日至2018年6月30日 | 0.00 | 13,553,151.66 | 0.00 | 13,553,151.66 | 20.03 |

产品持有风险

1.持有人大会投票权集中的风险
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。
2.巨额赎回的风险
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。
3.基金规模较小导致的风险
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。

注:计算上表份额占比时,未将美元份额折算为人民币份额。如果将美元份额按照2018年6月29日中国人民银行美元兑换人民币汇率中间价折算为人民币份额后进行计算,该份额占比为18.70%。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

汇添富基金管理股份有限公司

2018年08月25日

(上接 B703 版)

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 | 113015 | 隆基转债 | 24,742,172.80 | 6.98 |
| 2 | 128024 | 宁行转债 | 23,947,635.03 | 6.75 |
| 3 | 123006 | 东财转债 | 18,164,017.29 | 5.12 |
| 4 | 132005 | 15国资EB | 18,098,850.00 | 5.10 |
| 5 | 128028 | 赣锋转债 | 17,653,482.18 | 4.98 |
| 6 | 113014 | 林洋转债 | 17,305,324.80 | 4.88 |
| 7 | 113011 | 光大转债 | 16,784,792.00 | 4.73 |
| 8 | 123003 | 蓝思转债 | 13,867,540.96 | 3.91 |
| 9 | 128029 | 太阳转债 | 13,541,407.03 | 3.82 |
| 10 | 113009 | 广汽转债 | 12,263,100.00 | 3.46 |
| 11 | 128016 | 雨虹转债 | 11,526,407.86 | 3.25 |
| 12 | 110031 | 航信转债 | 7,946,701.00 | 2.24 |
| 13 | 110032 | 三一转债 | 7,338,624.60 | 2.07 |
| 14 | 128032 | 双环转债 | 6,368,924.44 | 1.80 |
| 15 | 110040 | 生益转债 | 5,095,480.80 | 1.44 |
| 16 | 110034 | 九州转债 | 2,435,995.00 | 0.69 |
| 17 | 110042 | 航电转债 | 1,217,637.00 | 0.34 |
| 18 | 128013 | 洪涛转债 | 237,344.76 | 0.07 |
| 19 | 110041 | 蒙电转债 | 20,790.00 | 0.01 |

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

## §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 汇添富可转换债券A | 8,917 | 19,067.96 | 106,927,597.90 | 62.89% | 63,101,430.11 | 37.11% |
| 汇添富可转换债券C | 5,630 | 22,135.07 | 68,641,674.64 | 55.08% | 55,978,780.08 | 44.92% |
| 合计 | 14,547 | 20,254.99 | 175,569,272.54 | 59.59% | 119,080,210.19 | 40.41% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 汇添富可转换债券A | 4,189.87 | 0.00% |
| | 汇添富可转换债券C | 1,038.34 | 0.00% |
| | 合计 | 5,228.21 | 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的情况

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

## §9 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 汇添富可转换债券A | 汇添富可转换债券C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2011年6月17日)基金份额总额 | 534,705,517.36 | 388,035,424.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 58,584,856.16 | 53,652,493.22 |
| 本报告期基金总申购份额 | 233,220,381.05 | 94,246,401.20 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 121,776,209.20 | 23,278,439.70 |
| 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 | 170,029,028.01 | 124,620,454.72 |

注:"总申购份额"含红利再投资、转换入份额;"总赎回份额"含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1.(汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金基金合同)于2018年1月19日正式生效,胡昕炜先生任该基金的基金经理.
2.(汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同)于2018年1月25日正式生效,吴江宏先生任该基金的基金经理.
3.(汇添富熙和精选混合型证券投资基金基金合同)于2018年2月11日正式生效,曾刚先生任该基金的基金经理.
4.(汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金基金合同)于2018年2月13日正式生效,陈加荣先生任该基金的基金经理.
5.(汇添富行业整合主题混合型证券投资基金基金合同)于2018年2月13日正式生效,赵鹏程先生任该基金的基金经理.
6.(汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金基金合同)于2018年2月13日正式生效,陈建玮先生和劳杰男先生任该基金的基金经理.
7.基金管理人于2018年2月14日公告,增聘胡娜女士担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理,与陈加荣先生共同管理该基金.
8.基金管理人2018年3月2日公告,劳杰男先生不再担任汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的基金经理,由李威先生单独管理该基金.
9.基金管理人于2018年3月2日公告,增聘邓慧莲女士担任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理,与曾刚先生共同管理该基金.
10.(汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同)于2018年3月8日正式生效,李怀宏先生和陆文磊先生任该基金的基金经理.
11.基金管理人于2018年3月20日公告,增聘赵鹏飞先生担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理,与陈加荣先生、胡娜女士共同管理该基金.
12.(汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同)于2018年3月23日正式生效,吴振翔先生和许一尊先生任该基金的基金经理.
13.基金管理人于2018年4月3日公告,增聘邓慧莲女士担任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,与曾刚先生共同管理该基金.
14.(汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同)于2018年4月16日正式生效,吴江宏先生和胡娜女士任该基金的基金经理.
15.(汇添富智能制造股票型证券投资基金基金合同)于2018年4月23日正式生效,赵鹏飞先生任该基金的基金经理.
16.(汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同)于2018年4月26日正式生效,陈加荣先生任该基金的基金经理.
17.基金管理人于2018年5月5日公告,蒋文玲女士不再担任汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理,增聘徐寅超女士担任该基金的基金经理,由徐寅超女士单独管理该基金.
18.基金管理人于2018年5月5日公告,蒋文玲女士不再担任汇添富理财30天债券型证券投资基金的基金经理,增聘徐寅超女士担任该基金的基金经理,由徐寅超女士单独管理该基金.
19.基金管理人于2018年5月5日公告,蒋文玲女士不再担任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理,增聘徐寅超女士担任该基金的基金经理,由徐寅超女士单独管理该基金.
20.基金管理人于2018年5月5日公告,徐寅超女士不再担任汇添富金鑫宝货币市场基金的基金经理,与蒋文玲女士共同管理该基金.
21.基金管理人于2018年5月5日公告,陆文磊先生和徐寅超女士不再担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理,由陶然先生单独管理该基金.
22.基金管理人于2018年5月5日公告,徐寅超女士不再担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理,增聘陶然先生担任该基金的基金经理,由陶然先生单独管理该基金.
23.基金管理人于2018年5月5日公告,增聘徐寅超女士担任汇添富货币市场基金的基金经理,与蒋文玲女士共同管理该基金.
24.基金管理人2018年5月17日公告,韩贤旺先生和欧阳沁春先生不再担任汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,由杨瑗先生单独管理该基金.
25.(汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金(LOF)基金合同)于2018年5月23日正式生效,过蓉蓉女士任该基金的基金经理.
26.基金管理人2018年5月29日公告,聘任茹奕嘉为汇添富6月红添利定期开放债券型证券投资基金,汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金,汇添富多元收益债券型证券投资基金,汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金,汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金,汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金,汇添富双利增强债券型证券投资基金,汇添富双利债券型证券投资基金,汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理助理,协助上述基金的基金经理开展投资管理工作.
27.(汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金基金合同)于2018年6月21日正式生效,杨瑗先生任该基金的基金经理.
28.本报告期内无基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形.

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人,基金财产的诉讼事项。
本报告期内,无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东方证券 | 2 | 342,826,950.26 | 100.00% | 316,074.47 | 100.00% | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰联合证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 福银证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 民族证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |

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 | 1,250,690,436.99 | 100.00% | 2,890,200,000.00 | 100.00% | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰联合证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | - | - | - | - | - | - |
| 福银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内新增1家证券公司的2个交易单元:中泰证券(上交所单元)、东兴证券(上交所单元)、中投证券(上交所单元)。

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金份额情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 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 | 2018年1月1日至2018年6月30日 | 213,619,931.36 | - | - | 213,619,931.36 | 49.12% |
| | 2 | 2018年2月12日至2018年6月30日 | 129,197,425.65 | - | - | 129,197,425.65 | 29.70% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

产品持有风险

1.持有人大会投票权集中的风险
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。
2.巨额赎回的风险
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。
3.基金规模较小导致的风险
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。

汇添富基金管理股份有限公司

2018年8月25日

(上接 B704 版)

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000651 | 格力电器 | 662,219 | 31,223,625.85 | 6.92 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 38,087 | 27,859,117.02 | 6.17 |
| 3 | 600104 | 上汽集团 | 535,099 | 18,723,114.01 | 4.15 |
| 4 | 601888 | 中国国旅 | 288,217 | 18,564,056.97 | 4.11 |
| 5 | 002507 | 涪陵榨菜 | 113,640 | 2,918,275.20 | 0.65 |
| 6 | 603589 | 口子窖 | 33,787 | 2,076,211.15 | 0.46 |

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末基金资产净值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 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 000651 | 格力电器 | 45,713,128.23 | 10.13 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 41,842,666.43 | 9.27 |
| 3 | 601888 | 中国国旅 | 38,869,848.97 | 8.61 |
| 4 | 600104 | 上汽集团 | 35,516,195.10 | 7.87 |
| 5 | 002507 | 涪陵榨菜 | 30,812,387.20 | 6.83 |
| 6 | 