汇添富价值精选混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2018年8月25日

§1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富价值精选混合
基金主代码	519069
前端交易代码	519069
后端交易代码	519070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年1月23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	3,490,279,813.46份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选价值相对低估的优质公司股票,在有效管理风险的前提下,追求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金采用灵活积极的资产配置和股票投资策略。在资产配置中,通过以宏观经济及宏观政策分析为核心的情景分析法来确定投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例,并结合对市场估值、市场资金、投资主体行为和市场信心影响等因素的综合判断进行灵活调整;在股票投资中,采取"自下而上"的策略,优选价值相对低估的优质公司股票构建投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得长期持续稳健的投资收益。本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是混合型基金,本基金的风险和预期收益比较均衡,在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。

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	010-66105798
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@cbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105799

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半年度报告备置地点	上海市富城路99号震旦国际大楼19-22层汇添富基金管理股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	170,976,038.23
本期利润	-12,878,731.87
加权平均基金份额本期利润	-0.0048
本期基金份额净值增长率	1.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.7987
期末基金资产净值	8,332,578,242.19
期末基金份额净值	2.387

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	-5.96%	1.36%	-6.04%	1.03%	0.08%	0.33%
过去三个月	-1.16%	1.23%	-7.65%	0.91%	6.49%	0.32%
过去六个月	1.27%	1.25%	-9.75%	0.92%	11.02%	0.33%
过去一年	13.38%	1.08%	-2.77%	0.76%	16.15%	0.32%
过去三年	22.91%	1.52%	-15.09%	1.19%	38.00%	0.33%
自基金合同生效日起至今	437.68%	1.42%	64.79%	1.23%	372.89%	0.19%

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》生效之日起(2009年1月23日)6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立,经中国证监会证监基金字(2005)5号文批准,于2005年2月3日正式成立,注册资本金为132,724,224元人民币。截止到2018年6月30日,公司管理证券投资基金规模约4213.15亿元,有效客户数约1988万户,资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理110只开放式证券投资基金,形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征,较为完善、有效的产品线,包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长混合型证券投资基金、汇添富成长焦点混合型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富民营活力混合型证券投资基金、汇添富香港优势混合型证券投资基金、汇添富医药保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)、深证300交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富6月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、汇添富理财30天债券型证券投资基金、汇添富理财60天债券型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富优选回报混合型证券投资基金、汇添富消费行业混合型证券投资基金、汇添富理财7天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽30混合型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富纯债债券型证券投资基金(LOF)、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富添富通货币市场基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务混合型证券投资基金、汇添富国企创新增长股票型证券投资基金、汇添富民营新动力股票型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富新兴消费股票型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金、汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富盈安保本混合型证券投资基金、汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金、汇添富盈稳保本混合型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫保本混合型证券投资基金、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金、汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)、汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金、汇添富鑫利债券型证券投资基金、汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、汇添富中国高端制造股票型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富精选美元债债券型证券投资基金、汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金、汇添富添福吉祥混合型证券投资基金、汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金、汇添富盈润混合型证券投资基金、汇添富沪深300指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富民丰回报混合型证券投资基金、汇添富睿丰混合型证券投资基金(LOF)、汇添富弘安混合型证券投资基金、汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金、汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金(LOF)、上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金、汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金、汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金、汇添富行业整合主题混合型证券投资基金、汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金、汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富智能制造股票型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
劳杰男	汇添富价值精选混合基金、汇添富沪港深大盘价值混合基金的基金经理,研究副总监。	2015年11月18日	-	8年	国籍:中国。学历:复旦大学经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2010年7月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任研究副总监。2015年7月10日至2018年3月1日任汇添富国企创新股票基金的基金经理,2015年11月18日至今任汇添富价值精选混合基金的基金经理,2018年2月13日至今任汇添富沪港深大盘价值混合基金的基金经理。

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4次,由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 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

2018年上半年,市场总体表现弱势,上证综指下跌13.90%,深圳成指下跌15.04%,沪深300下跌12.90%,创业板指数下跌8.33%,中小板指数下跌14.26%。且个股两极分化愈加明显,上半年仅16.5%的股票取得正的涨幅,71.3%的股票跌幅超过10%;50亿市值以下个股占比50%,而17年同期仅为32%。

添富价值在上半年仍延续"行业相对均衡、个股适度集中、适时动态调整"的风格和思路。操作上,淡化风格和择时,坚持自下而上精选个股的投资策略,并做到行业相对均衡配置,兼顾价值和成长。一季度,对17年四季度适当增加的地产股进行了兑现收益操作;二季度,对部分医药股进行了兑现收益的操作;基于中长期价值的考量,在下跌的过程中适度增加了金融股和部分化工子行业个股的持仓。组合仓位整体变化不大。

添富价值在上半年进行了每份0.079元的分红操作。除去分红,组合规模在上半年仍增加较多,感谢广大投资者的信任!

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富价值精选混合基金份额净值为2.387元,本报告期基金份额净值增长率为1.27%;同期业绩比较基准收益率为-9.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,中美经贸对抗的不确定性进展仍会影响市场的走势,但单就贸易战对经济和市场的负面影响应已在悲观的预期中有较多反应。国内经济在由"一刀切去杠杆"向"结构性去杠杆"过度,政策看到一定的边际放松,不至于太悲观,并应相信中国经济的韧性和强的内生增长动力。

与此同时,结构分化和高质量增长的时代特征下,一批优质公司迎来更好的生存环境,其所对应的优质股票也面临源源不断的资金流入,如海外资金、产业资本、居民财富的再配置,等等。拉长时间来看,相信这批股票带来的回报会有很不错的表现,尽管短期的波动会有加大。在当前位置,更应对中国的权益市场充满信心,尤其是对于那些代表优秀公司的优质股票,从稍长期来看,几乎没有其它更好的投资选择可以替代。

添富价值仍坚持自下而上优选个股集中,并相对均衡配置资产,不论是行业还是风格。向下有安全边际并有不错向上弹性的稳健价值类或稳健成长类个股为核心配置,高成长类个股和周期反转类个股注重"准心",特别提防买入伪成长概念类个股或周期波动阶段的博弈类个股。行业配置方面,消费升级、先进制造、科技创新和改革、行业整合等,仍是添富价值主要关注的方向。在各行业中,研究龙头公司并以合理的价格买入以及寻找细分行业的潜在龙头公司是重中之重。

作为机构投资者,我们仍希望能够时刻保持良好且积极的心态,发挥自身在选股和风险控制方面的优势,通过深入研究并寻找具有良好盈利模式和竞争优势、优秀管理团队、合理估值水平的公司,并通过中长期持股来获取长期较好的回报。添富价值看淡短期排名,追求持续稳定增长的较高的年复合收益,尽管短期会有压力。再次感谢广大投资者的理解和信任!

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《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及2017年9月5日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(2017年9月5日《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止)等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会,负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,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。

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: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,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的15%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。

本基金于2018年06月04日实施利润分配,每10份基金份额派发红利0.790元人民币。

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,本基金托管人在对汇添富价值精选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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,汇添富价值精选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价值精选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。本报告期内汇添富价值精选混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为250,212,757.91元。

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价值精选混合型证券投资基金2018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:汇添富价值精选混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	471,884,853.03	415,424,306.46
结算备付金	16,741,243.08	7,525,542.28
存出保证金	1,015,609.37	778,398.21
交易性金融资产	7,215,039,396.62	4,659,720,955.75
其中:股票投资	6,864,509,396.62	4,605,484,055.75
基金投资	-	-
债券投资	350,530,000.00	54,236,900.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	905,605,364.42	200,000,500.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	9,457,039.76	1,526,987.15
应收股利	-	-
应收申购款	38,474,745.58	12,293,349.41
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	8,658,218,251.86	5,297,270,039.26
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	291,065,529.70	35,814,915.47
应付赎回款	18,679,323.15	3,424,485.61
应付管理人报酬	10,092,414.14	6,543,252.44
应付托管费	1,682,069.01	1,090,542.08
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,760,775.03	3,182,678.08
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	359,898.64	397,665.39
负债合计	325,640,009.67	50,453,539.07
所有者权益:		
实收基金	3,490,279,813.46	2,157,498,326.38
未分配利润	4,842,298,428.73	3,089,318,173.81
所有者权益合计	8,332,578,242.19	5,246,816,500.19
负债和所有者权益总计	8,658,218,251.86	5,297,270,039.26

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值2.387元,基金份额总额3,490,279,813.46份。

6.2 利润表

会计主体:汇添富价值精选混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	57,057,219.47	512,347,795.33
1.利息收入	10,520,340.39	3,010,196.42
其中:存款利息收入	2,239,019.41	1,455,369.62
债券利息收入	5,228,921.91	1,537,415.08
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,052,399.07	17,411.72
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	228,893,258.60	104,005,429.45
其中:股票投资收益	174,061,609.80	82,966,546.72
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,027,679.20	-143,920.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	52,803,969.60	21,182,802.73
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-183,854,770.10	404,417,236.62
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,498,390.58	914,932.84
减:二、费用	69,935,951.34	34,657,601.18
1.管理人报酬	49,865,208.72	25,700,208.14
2.托管费	8,310,868.12	4,283,368.07
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	11,542,550.26	4,470,354.28
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	8.81	-
7.其他费用	217,315.43	203,670.69
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-12,878,731.87	477,690,194.15

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富价值精选混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	2,157,498,326.38	3,089,318,173.81	5,246,816,500.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-12,878,731.87	-12,878,731.87
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)	1,332,781,487.08	2,016,071,744.70	3,348,853,231.78
其中:1.基金申购款	1,830,531,306.52	2,776,308,093.87	4,606,839,400.39
2.基金赎回款	-497,749,819.44	-760,236,349.17	-1,257,986,168.61
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)	-	-250,212,757.91	-250,212,757.91
五、期末所有者权益(基金净值)	3,490,279,813.46	4,842,298,428.73	8,332,578,242.19

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	1,432,465,017.48	1,959,034,685.55	3,391,499,703.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	477,690,194.15	477,690,194.15
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)	-62,305,980.25	-88,695,897.45	-151,001,877.70
其中:1.基金申购款	349,980,906.88	536,792,890.06	886,773,796.94
2.基金赎回款	-412,286,887.13	-625,488,787.51	-1,037,775,674.64
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)	1,370,159,037.23	2,348,028,982.25	3,718,188,019.48

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

汇添富价值精选混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),原汇添富价值精选股票型证券投资基金,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[2008]1317号文《关于核准汇添富价值精选股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人汇添富基金管理有限公司(现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2009年1月23日正式生效,首次设立募集规模为1,512,522,680.68份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据中国证券监督管理委员会于2014年8月8日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定,经与基金托管人协商一致,汇添富基金管理股份有限公司决定自2015年8月5日起将本基金变更为混合基金,并相应修改本基金的《基金合同》。

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、债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金坚持长期价值投资的理念,采用深入的"自下而上"的公司基本面分析方法,精选价值相对低估的优质公司进行投资布局,通过科学的组合管理,实现投资目标。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2018年6月30日的财务状况以及2018年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,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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 关联方关系

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

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

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("工商银行")	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	244,885,075.96	2.91%	352,213,855.89	12.30%

6.4.8.1.2 债券交易

注:本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券股份有限公司	400,000,000.00	3.23%	-	-

注:本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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	226,296.27	2.93%	85,711.60	2.28%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	323,521.34	12.26%	123,623.98	9.35%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	49,865,208.72	25,700,208.14
其中:支付销售机构的客户维护费	5,935,819.16	4,675,334.74

注:基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷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,由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月前2个工作日内从基金资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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	8,310,868.12	4,283,368.07

注:基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效日(2009年1月23日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	8,103,322.53	8,103,322.53
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	8,103,322.53	8,103,322.53
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.23%	0.59%

注:本基金的基金管理人本报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国工商银行股份有限公司	471,884,853.03	2,033,802.35	284,195,576.60	1,421,064.18

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002044	美年健康	2017年11月22日	-	非公开发行流通受限	17.61	21.31	1,737,649	25,500,002.01	37,029,300.19	-
002044	美年健康	2017年11月22日	-	非公开发行流通受限	17.61	20.57	1,737,649	25,500,002.01	35,743,439.93	-
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,864,509,396.62	79.28
	其中:股票	6,864,509,396.62	79.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	350,530,000.00	4.05
	其中:债券	350,530,000.00	4.05
	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	905,605,364.42	10.46
	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	488,626,096.11	5.64
8	其他各项资产	48,947,394.71	0.57
9	合计	8,658,218,251.86	100.00

7.2 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	3,938,950,125.35	47.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	241,220,757.40	2.89
G	交通运输、仓储和邮政业	54,000,000.00	0.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,675,988,450.60	20.11
K	房地产业	45,583,140.43	0.55
L	租赁和商务服务业	264,132,995.28	3.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	97,080,000.00	1.17
Q	卫生和社会工作	547,401,141.57	6.57
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,864,509,396.62	82.38

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投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	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	601318	中国平安	10,000,098	585,805,740.84	7.03
2	600036	招商银行	20,000,026	528,800,687.44	6.35
3	300003	乐普医疗	10,000,076	366,802,787.68	4.40
4	000333	美的集团	7,000,009	365,540,469.98	4.39
5	600867	通化东宝	15,000,034	359,550,814.98	4.32
6	600426	华鲁恒升	20,000,027	351,800,474.93	4.22
7	601939	建设银行	52,000,047	340,600,307.85	4.09
8	002415	海康威视	9,000,036	334,171,336.68	4.01
9	600436	片仔癀	2,900,033	324,600,693.69	3.90
10	002044	美年健康	14,475,363	321,374,209.12	3.86

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

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	600036	招商银行	440,668,988.38	8.40
2	601318	中国平安	291,823,255.83	5.56
3	002027	分众传媒	252,191,584.52	4.81
4	600436	片仔癀	249,671,404.81	4.76
5	603288	海天味业	230,386,835.79	4.39
6	601933	永辉超市	217,899,831.34	4.15
7	300015	爱尔眼科	207,984,782.64	3.96
8	002258	利尔化学	202,693,523.42	3.86
9	601233	桐昆股份	184,694,071.67	3.52
10	601939	建设银行	183,624,099.16	3.50
11	600779	水井坊	180,568,172.53	3.44
12	600309	万华化学	179,825,491.73	3.43
13	300408	三环集团	172,886,195.89	3.30
14	600486	扬农化工	161,326,344.12	3.07
15	603515	欧普照明	150,153,813.93	2.86
16	000333	美的集团	149,869,973.29	2.86
17	600426	华鲁恒升	140,615,003.07	2.68
18	600030	中信证券	134,034,415.37	2.55
19	002415	海康威视	133,902,732.23	2.55
20	601688	华泰证券	129,531,539.72	2.47
21	000703	恒逸石化	117,058,018.49	2.23
22	600867	通化东宝	112,407,996.76	2.14
23	002044	美年健康	109,511,741.01	2.09
24	002008	大族激光	109,069,302.18	2.08
25	000661	长春高新	107,526,621.76	2.05
26	000063	中兴通讯	106,370,008.78	2.03

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	002008	大族激光	254,990,147.50	4.86
2	000661	长春高新	246,309,562.41	4.69
3	000826	启迪桑德	190,827,855.60	3.64
4	600703	三安光电	164,357,835.33	3.13
5	601688	华泰证券	160,985,703.13	3.07
6	600048	保利地产	159,381,524.11	3.04
7	600030	中信证券	157,399,648.78	3.00
8	600519	贵州茅台	141,140,464.87	2.69
9	600779	水井坊	136,394,194.05	2.60
10	000002	万科A	128,690,692.15	2.45
11	601668	中国建筑	124,420,874.25	2.37
12	603658	安图生物	110,761,348.27	2.11
13	600690	青岛海尔	98,417,209.97	1.88
14	000063	中兴通讯	97,698,962.35	1.86
15	601717	郑煤机	81,379,681.12	1.55
16	300003	乐普医疗	77,611,682.99	1.48
17	600340	华夏幸福	73,576,275.04	1.40
18	002415	海康威视	64,997,122.91	1.24
19	002475	立讯精密	56,987,418.34	1.09
20	000333	美的集团	54,630,446.00	1.04

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	5,337,929,271.52
卖出股票收入(成交)总额	3,068,177,170.35

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	350,530,000.00	4.21
	其中:政策性金融债	350,530,000.00	4.21
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	350,530,000.00	4.21

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	170207	17国开07	1,500,000	150,000,000.00	1.80
2	180404	18农发04	1,000,000	100,300,000.00	1.20
3	170413	17农发13	1,000,000	100,230,000.00	1.20

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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持有国债期货投资。

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

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,015,609.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,457,039.76
5	应收申购款	38,474,745.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,947,394.71

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

金额单位:人民币元

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(%)	流通受限情况说明
1	002044	美年健康	72,772,740.12	0.87	非公开发行流通受限

§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
202,206	17,261.01	1,795,545,260.28	51.44%	1,694,734,553.18	48.56%

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	4,979,027.26	0.14%

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(2009年1月23日)基金份额总额	1,512,522,680.68
本报告期期初基金份额总额	2,157,498,326.38
本报告期基金总申购份额	1,830,531,306.52
减:本报告期基金总赎回份额	497,749,819.44
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	3,490,279,813.46

注:表内"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 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1.《汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2018年1月19日正式生效,胡昕炜先生任该基金的基金经理。

2.《汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2018年1月25日正式生效,吴江宏先生任该基金的基金经理。

3.《汇添富熙和精选混合型证券投资基金基金合同》于2018年2月11日正式生效,曾刚先生任该基金的基金经理。

4.《汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2018年2月13日正式生效,陈加荣先生任该基金的基金经理。

5.《汇添富行业整合主题混合型证券投资基金基金合同》于2018年2月13日正式生效,赵鹏程先生任该基金的基金经理。

6.《汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金基金合同》于2018年2月13日正式生效,陈健玮先生和劳杰男先生任该基金的基金经理。

7.基金管理人于2018年2月14日公告,增聘胡娜女士担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理,与陈加荣先生共同管理该基金。

8.基金管理人2018年3月2日公告,劳杰男先生不再担任汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的基金经理,由李威先生单独管理该基金。

9.基金管理人于2018年3月2日公告,增聘郑慧莲女士担任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理,与曾刚先生共同管理该基金。

10.《汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2018年3月8日正式生效,李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。

11.基金管理人于2018年3月20日公告,增聘赵鹏飞先生担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理,与陈加荣先生、胡娜女士共同管理该基金。

12.《汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于2018年3月23日正式生效,吴振翔先生和许一尊先生任该基金的基金经理。

13.基金管理人于2018年4月3日公告,增聘郑慧莲女士担任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,与曾刚先生共同管理该基金。

14.《汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2018年4月16日正式生效,吴江宏先生和胡娜女士任该基金的基金经理。

15.《汇添富智能制造股票型证券投资基金基金合同》于2018年4月23日正式生效,赵鹏飞先生任该基金的基金经理。

16.《汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2018年4月26日正式生效,陈加荣先生任该基金的基金经理。

17.基金管理人于2018年5月5日公告,蒋文玲女士不再担任汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理,增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理,由徐寅喆女士单独管理该基金。

18.基金管理人于2018年5月5日公告,蒋文玲女士不再担任汇添富理财30天债券型证券投资基金的基金经理,增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理,由徐寅喆女士单独管理该基金。

19.基金管理人于2018年5月5日公告,蒋文玲女士不再担任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理,增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理,由徐寅喆女士单独管理该基金。

20.基金管理人于2018年5月5日公告,徐寅喆女士不再担任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理,增聘陶然先生担任该基金的基金经理,由陶然先生单独管理该基金。

21.基金管理人于2018年5月5日公告,陆文磊先生和徐寅喆女士不再担任汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理,增聘陶然先生担任该基金的基金经理,由陶然先生单独管理该基金。

22.基金管理人于2018年5月5日公告,徐寅喆女士不再担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理,增聘陶然先生担任该基金的基金经理,由陶然先生单独管理该基金。

23.基金管理人于2018年5月5日公告,增聘徐寅喆女士担任汇添富货币市场基金的基金经理,与蒋文玲女士共同管理该基金。

24.基金管理人2018年5月17日公告,韩贤旺先生和欧阳沁春先生不再担任汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,由杨瑨先生单独管理该基金。

25.《汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金(LOF)基金合同》于2018年5月23日正式生效,过蓓蓓女士任该基金的基金经理。

26.基金管理人2018年5月29日公告,聘任茹奕菡为汇添富6月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理助理,协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

27.《汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金基金合同》于2018年6月21日正式生效,杨瑨先生任该基金的基金经理。

28.本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、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	
民生证券	1	1,129,302,819.72	13.44%	1,051,723.39	13.61%	-
太平洋证券	2	874,544,123.07	10.41%	807,964.04	10.46%	-
招商证券	2	808,915,228.63	9.63%	747,846.63	9.68%	-
中信证券	2	791,376,351.39	9.42%	721,182.14	9.33%	-
国盛证券	2	750,443,463.26	8.93%	686,514.59	8.88%	-
中金公司	2	706,630,123.49	8.41%	656,971.61	8.50%	-
天风证券	2	541,855,637.50	6.45%	501,221.66	6.49%	-
广发证券	2	520,911,028.17	6.20%	482,257.36	6.24%	-
海通证券	2	470,689,789.56	5.60%	436,988.96	5.66%	-
中投证券	2	425,538,286.88	5.06%	393,264.41	5.09%	-
东方证券	2	244,885,075.96	2.91%	226,296.27	2.93%	-
国金证券	2	230,126,308.06	2.74%	211,516.74	2.74%	-
西藏东方财富	2	170,909,522.35	2.03%	123,459.75	1.60%	-
光大证券	1	166,097,201.33	1.98%	151,364.41	1.96%	-
方正证券	2	139,418,779.93	1.66%	128,635.68	1.66%	-
信达证券	2	132,851,314.25	1.58%	123,492.43	1.60%	-
华创证券	1	124,857,509.14	1.49%	113,782.79	1.47%	-
新时代证券	2	95,126,608.58	1.13%	88,592.23	1.15%	-
银河证券	1	79,173,214.84	0.94%	73,733.64	0.95%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
上海华信证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	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
民生证券	-	-	1,950,000,000.00	15.73%	-	-
太平洋证券	-	-	1,450,000,000.00	11.69%	-	-
招商证券	-	-	1,400,000,000.00	11.29%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	700,000,000.00	5.65%	-	-
天风证券	-	-	1,000,000,000.00	8.06%	-	-
广发证券	-	-	1,200,000,000.00	9.68%	-	-
海通证券	-	-	1,950,000,000.00	15.73%	-	-
中投证券	-	-	550,000,000.00	4.44%	-	-
东方证券	-	-	400,000,000.00	3.23%	-	-
国金证券	7,113,316.70	57.68%	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	150,000,000.00	1.21%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	150,000,000.00	1.21%	-	-
华创证券	5,219,706.38	42.32%	-	-	-	-
新时代证券	-	-	700,000,000.00	5.65%	-	-
银河证券	-	-	800,000,000.00	6.45%	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
上海华信证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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3家证券公司的6个交易单元:中邮证券(上交所单元和深交所单元)、新时代证券(上交所单元和深交所单元)、国盛证券(上交所单元和深交所单元)。

§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

注:无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

汇添富基金管理股份有限公司

2018年8月25日