汇添富均衡增长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

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	汇添富均衡增长混合
基金主代码	519018
前端交易代码	519018
后端交易代码	519010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年8月7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	7,312,558,000.48份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金应用"由上而下"和"自下而上"相结合的投资策略,通过行业的相对均衡配置和投资布局于具有持续增长潜质的企业,在有效控制风险的前提下,分享中国经济的持续增长,以持续稳定地获取较高的投资回报。
投资策略	本基金采用"由上而下"和"自下而上"相结合的投资方法,适度动态调整资产配置,行业保持相对均衡配置,同时通过三级过滤模型(Tri-Filtering Model)来构建核心股票池,深入剖析核心股票池企业的增长逻辑和增长战略,以达到审慎精选,并对投资组合进行积极而有效的风险管理。
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	本基金为混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金

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	010-66105798
	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号富且国际大楼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	111,428,235.23
本期利润	-471,698,403.09
加权平均基金份额本期利润	-0.0634
本期基金份额净值增长率	-9.78%
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	0.2149
期末基金资产净值	4,386,584,267.23
期末基金份额净值	0.5999

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。

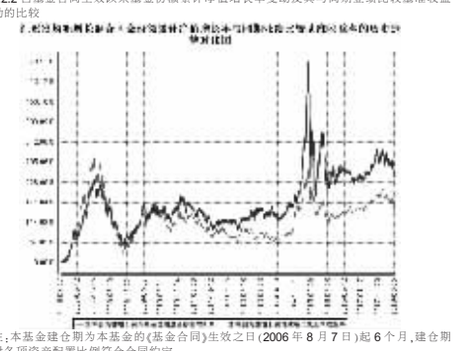
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	-4.58%	1.60%	-6.04%	1.03%	1.46%	0.57%
过去三个月	-9.46%	1.27%	-7.65%	0.91%	-1.81%	0.36%
过去六个月	-9.78%	1.26%	-9.75%	0.92%	-0.03%	0.34%
过去一年	-0.70%	1.11%	-2.77%	0.76%	2.07%	0.35%
过去三年	-26.33%	2.03%	-15.09%	1.19%	-11.24%	0.84%
自基金合同生效日起至今	256.25%	1.67%	156.35%	1.44%	99.90%	0.23%

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的(基金合同)生效之日(2006年8月7日)起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、汇添富收益快钱货币市场基金、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、汇添富普丰混合型证券投资基金、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		
余中强	汇添富沪港深新价值股票基金、汇添富均衡增长混合基金、添富港股通专注成长基金的基金经理。	2016年8月24日	-	11年	国籍:中国,学历:香港城市大学博士,清华大学MBA学位。从业经历:曾任香港邦盟汇资基金管理有限公司研究主任,香港朗宁投资有限公司投资经理,东兴证券股份有限公司投资经理,齐鲁证券有限公司北京证券资产管理分公司执行总经理,华商盛世成长股票型基金基金经理助理,华商产业升级混合型基金基金经理。2016年1月加入汇添富基金管理股份有限公司。2016年8月1日至今任汇添富沪港深新价值股票基金的基金经理,2016年8月24日至今任汇添富均衡增长混合基金的基金经理,2017年11月10日至今担任汇添富港股通专注成长基金的基金经理。

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,在美国经济的持续向好,以及由此导致的美联储加快加息和缩表节奏的背景下,美元震荡走强,美国资本市场受益于资金从新兴市场撤出,以及权重公司业绩持续超预期,而呈现出一枝独秀的表现。其他大部分权益市场表现一般,在二季度中后期,更是受到强势美元的冲击,风险偏好加速回落,股指表现承压。总体而言,科技类和消费类的绩优公司的相对表现仍较为亮眼。

国内经济在上半年增长稳定,政策的连贯性决定了在"去杠杆"的大趋势下,上半年整体流动性持续稳中偏紧,叠加中美贸易摩擦、美国加息、缩表等产生的剧烈波动的影响,导致国内资本市场的整体表现相对平稳,结构性机会相对突出。今年的春节相对较早,导致了部分消费品提前体现出了稳健的数据增长,但是,节后的新开工旺季不旺,影响了市场对于未来的经济预期和整体风险偏好。在国内加速去杠杆和升级的国际贸易摩擦的双重压力之下,导致了市场资金进一步抱团于优质的医药和消费标的。总体而言,盈利确定性强且估值合理的个股,在上半年的相对表现较为突出。

本基金在上半年坚持精选个股的投资策略,加大对于云计算、自主可控、创新药板块的投资权重,继续在"消费升级、制造业升级、大金融"的三条主线之下,积极寻找优质的投资标的,并不断优化组合结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富均衡增长混合基金份额净值为0.5999元,本报告期基金份额净值增长率为-9.78%;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

我们预判2018年下半年全球经济将继续复苏,国内经济继续保持平稳。美联储的加速缩表,在刺激美元强势的同时,也将进一步吸引全球资金从新兴市场往成熟市场再配置。原油价格的高位波动,将成为影响主要经济体复苏节奏的重要因素。如果大宗商品的价格进一步上涨,则全球的通胀压力将进一步显现,这会导致主要国家跟随美国的步伐,加速货币政策回归常态化。因此,从全球范围来看,受益于利率上行的板块大概率将在下半年迎来不错的投资机会。

在国内经济、政策稳定的背景下,出现系统性风险的概率较低。在国内需求稳定的背景下,供给侧改革较为彻底的行业,将从利润端得到明显改善。同时,在去杠杆的大趋势下,参与全球定价的行业龙头公司,其优势将进一步强化。我们将坚持在结构性行情中寻找有真正优秀的公司,特别是业务模式清晰、竞争力强、公司治理好的公司。我们的投资方向将继续集中在"消费升级、制造业升级、大金融"的三条主线之下,精选个股,挖掘出优秀标的。

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50%,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。

4.8 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均衡增长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,汇添富均衡增长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均衡增长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,汇添富均衡增长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均衡增长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:汇添富均衡增长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	464,871,825.43	542,822,771.33
结算备付金	27,838,762.62	22,162,584.16
存出保证金	1,894,818.64	1,829,812.88
交易性金融资产	3,897,156,334.51	4,316,268,079.19
其中:股票投资	3,696,626,334.51	4,111,876,079.19
基金投资	-	-
债券投资	200,530,000.00	204,392,000.00
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	349,730,194.87	200,000,350.00
应收证券清算款	-	108,737,573.93
应收利息	3,980,296.25	5,291,885.75
应收股利	-	-
应收申购款	701,107.77	256,570.94
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,746,173,340.09	5,197,369,628.18
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	343,324,126.11	78,034,518.23
应付赎回款	721,567.65	1,389,531.85
应付管理人报酬	5,509,083.61	6,518,120.95
应付托管费	918,180.60	1,086,353.50
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	8,522,704.51	6,185,306.36
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	593,410.38	751,498.85
负债合计	359,589,072.86	93,965,329.74
所有者权益:		
实收基金	2,815,218,690.00	2,955,099,113.94
未分配利润	1,571,365,577.23	2,148,305,184.50
所有者权益合计	4,386,584,267.23	5,103,404,298.44
负债和所有者权益总计	4,746,173,340.09	5,197,369,628.18

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.5999元,基金份额总额7,312,558,000.48份。

6.2 利润表

会计主体:汇添富均衡增长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	-404,008,641.93	381,712,061.48
1.利息收入	10,124,268.04	7,034,739.43
其中:存款利息收入	2,762,680.23	2,414,829.77
债券利息收入	3,594,782.14	946,849.31
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,766,805.67	3,673,060.35
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"号填列)	168,872,949.22	-55,286,609.14
其中:股票投资收益	143,284,409.76	-82,528,371.42
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,788,393.44	-
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	22,800,146.02	27,241,762.28
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-583,126,638.32	429,640,539.38
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	120,779.13	323,391.81
减:二、费用	67,689,761.16	72,560,648.51
1.管理人报酬	36,198,156.82	36,742,778.92
2.托管费	6,033,026.14	6,123,796.51
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	25,190,000.12	29,423,180.79
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	5.81	-
7.其他费用	268,572.27	270,892.29
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-471,698,403.09	309,151,412.97

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富均衡增长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)	2,955,099,113.94	2,148,305,184.50	5,103,404,298.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	-471,698,403.09	-471,698,403.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-139,880,423.94	-105,241,204.18	-245,121,628.12
其中:1.基金申购款	67,209,403.87	46,192,573.27	113,401,977.14
2.基金赎回款	-207,089,827.81	-151,433,777.45	-358,523,605.26
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)	2,815,218,690.00	1,571,365,577.23	4,386,584,267.23

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)	3,433,546,024.91	1,627,597,050.54	5,061,143,075.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	309,151,412.97	309,151,412.97
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)	-233,679,504.70	-115,657,416.10	-349,336,920.80
其中:1.基金申购款	45,990,171.54	22,044,157.11	68,034,328.65
2.基金赎回款	-279,669,676.24	-137,701,573.21	-417,371,249.45
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)	3,199,866,520.21	1,821,091,047.41	5,020,957,567.62

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 李晓 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

汇添富均衡增长混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),原汇添富均衡增长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[2006]125号文《关于同意汇添富均衡增长股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由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2006年8月7日正式生效,首次设立募集规模为4,935,775,576.48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本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金应用"由上而下"和"自下而上"相结合的投资方法,适度动态调整资产配置,行业保持相对均衡配置,同时通过三级过滤模型(Tri-Filtering Model)来构建核心股票池深入剖析核心股票池企业的增长逻辑和增长战略,以达到审慎精选,并对投资组合进行积极而有效的风险管理。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%。

2007年8月15日(拆分日),本基金管理人汇添富基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分前,本基金的基金份额净值为人民币2.5975元,根据基金份额拆分公式,计算精确到小数点后第9位(第9位以后舍去)为人民币2.597500910元。本基金管理人于拆分日,按照1:2.597500910的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后,基金份额净值为人民币1.0000元,基金份额面值为人民币0.3850元。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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(以下合称"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的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《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〉》及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