汇添富新睿精选灵活配置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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	汇添富新睿精选混合	
基金主代码	001816	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月21日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	154,156,298.45份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇添富新睿精选混合A	汇添富新睿精选混合C
下属分级基金的交易代码:	001816	002164
报告期末下属分级基金的份额总额	113,407,548.11份	40,748,750.34份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过积极主动的资产配置,充分挖掘各大类资产投资机会,力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素,结合全球宏观经济形势,研判国内外经济的发展趋势,并在严格控制投资组合风险的前提下,对投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种进行战略配置和动态调整,以规避或分散市场风险,力争实现基金资产的中长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	贺倩
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-68121816

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

基金级别	汇添富新睿精选混合A	汇添富新睿精选混合C
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)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	12,879,757.65	4,178,939.01
本期利润	2,158,135.71	817,713.46
加权平均基金份额本期利润	0.0153	0.0178
本期基金份额净值增长率	1.03%	0.83%
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	0.0837	0.0975
期末基金资产净值	122,901,081.01	44,720,532.98
期末基金份额净值	1.084	1.097

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

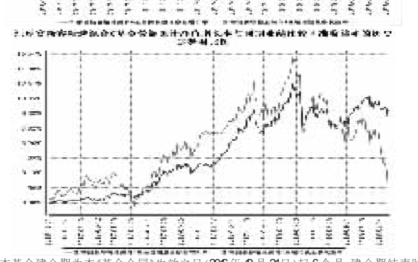
汇添富新睿精选混合A

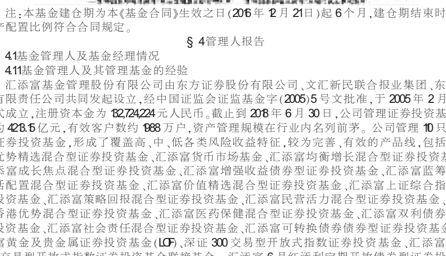
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.73%	0.27%	-3.66%	0.64%	2.93%	-0.37%
过去三个月	1.59%	0.26%	-4.47%	0.57%	6.06%	-0.31%
过去六个月	1.03%	0.33%	-5.37%	0.57%	6.40%	-0.24%
过去一年	5.55%	0.29%	-1.71%	0.47%	7.26%	-0.18%
自基金合同生效日起至今	8.40%	0.24%	2.99%	0.42%	5.41%	-0.18%

汇添富新睿精选混合C

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	-0.81%	0.27%	-3.66%	0.64%	2.85%	-0.37%
过去三个月	1.39%	0.26%	-4.47%	0.57%	5.86%	-0.31%
过去六个月	0.83%	0.33%	-5.37%	0.57%	6.20%	-0.24%
过去一年	6.20%	0.29%	-1.71%	0.47%	7.91%	-0.18%
自基金合同生效日起至今	9.70%	0.24%	2.99%	0.42%	6.71%	-0.18%

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(2016年12月21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、汇添富香港优势精选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、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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李怀定	汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富纯债(LOF)基金、汇添富达欣混合基金、汇添富盈鑫保本混合基金、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富长添利定期开放债券基金、汇添富新睿精选混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、汇添富年年泰定开混合基金、汇添富睿丰混合基金、添富鑫泽定开债基金的基金经理,汇添富增强收益债券基金的基金经理助理。	2016年12月21日	-	11年	国籍:中国。学历:复旦大学经济学博士。相关业务资格:基金从业资格。从业经历:曾任光大证券股份有限公司研究所债券分析师,国信证券股份有限公司经济研究所固定收益高级分析师。2012年5月加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益高级分析师。2015年5月25日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理助理,2015年11月18日至今任汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富纯债(LOF)基金(原汇添富互利分级债券基金)的基金经理,2015年12月2日至今任汇添富达欣混合基金的基金经理,2016年3月11日至今任汇添富盈鑫保本混合基金的基金经理,2016年3月16日至今任汇添富稳健添利定期开放债券基金的基金经理,2016年12月6日至今任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理,2016年12月21日至今任汇添富新睿精选混合基金的基金经理,2016年12月26日至今任汇添富鑫瑞债券基金的基金经理,2017年4月14日至今任汇添富年年泰定开混合基金的基金经理,2017年9月29日至今任汇添富睿丰混合基金的基金经理,2018年3月8日至今任添富鑫泽定开债基金的基金经理。

注:1.本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.本基金管理人于2018年8月4日公告,本基金的基金经理李怀定先生由于个人原因于2018年8月2日离任,并增聘蒋文玲女士为本基金的基金经理。

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

上半年,虽然GDP同比增速尚可,但微观经济出现明显下行压力,尤其是二季度,受中美贸易摩擦的演变影响,叠加去杠杆政策的深入导致社融增速迅速下行,主要经济金融指标基本都普遍低于预期。上半年前期,受去年高基数影响,叠加原油、煤炭、钢铁、水泥、有色等大宗商品价格下跌,工业品价格同比涨幅大幅回落,但上半年后期,受美国对伊朗制裁等地缘政治风险激化影响,大宗商品价格一度上涨,叠加去年低基础原因和去产能政策的推动,工业品价格指数较一季度小幅反弹,但总体幅度有限;上半年,CPI前期受基数和春节错位影响,同比增速出现反弹,但后期因需求不济,持续维持低位,显示当前的通胀压力不大。

上半年,货币政策出现明显的放松迹象,其中一季度尽管公开市场利率随美联储加息小幅抬升,但货币市场资金利率整体明显低于去年同期,季末资金利率也未明显抬升,而二季度,受社融下行、信用收缩担忧、主要经济指标不及预期、以及中美贸易摩擦引发经济下行的悲观预期等多重因素影响,货币政策出现进一步的宽松迹象,定向降准频发,货币市场资金面明显改善。

上半年,尽管市场依然担心金融监管政策,尤其是低等级信用债因“打破刚兑”政策延续,收益率持续调整,信用利差较之前进一步上行,但利率债和高等级信用债,在基本面和政策面的带动之下,尤其是二季度叠加风险资产回落带动风险偏好下行,收益率出现显著下行,主要品种较年初普遍下行了80-100bp以上。上半年受经济下行预期影响,股票市场虽然在一季度前期有所上涨,但在二季度出现明显回调,总体看,主要估值均出现不同幅度的下跌。

本基金灵活参与股票和债券市场的配置,尽可能追求绝对收益目标。整体而言,上半年后期明显加大了债券配置比例,组合杠杆和久期均明显高于去年四季度末水平。股票上,上半年股票配置较为灵活,仓位变化较大,但总体而言较去年四季度末有所下降。

报告期内,本基金A级净值增长率为1.03%,C级净值增长率为0.83%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富新睿精选混合A基金份额净值为1.084元,本报告期基金份额净值增长率为1.03%;截至本报告期末汇添富新睿精选混合C基金份额净值为1.097元,本报告期基金份额净值增长率为0.83%;同期业绩比较基准收益率为-5.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,虽然国内经济景气度可能没有生产数据显示的那么糟糕,但需求下滑已成事实。目前看,政府的调控思路已经开始发生变化,财政货币政策都开始出现转变,经济总体继续明显下滑的可能性较之前应该有所降低。下半年,工业品出厂价格指数同比增速7月可能会开始见顶,消费价格指数依然只是温和上升,今年年内应该还是看不到通胀压力。货币政策上,央行已经多次定向降准,虽然国务院会议对宽信用释放出明显的政策信号,地方债供给会增加,但资金面有望保持宽松局面,货币政策仍有进一步放松空间。

债券市场上,目前虽然地方债供给和宽信用苗头开始不利利率债走势,但鉴于政策放松力度仍相对有限,下半年利率债仍有配置价值。而信用债,尤其是中低评级产业债和城投债,近期随着融资问题的部分解决,加上预计后期仍有政策出台支持,相对吸引力较上半年会大幅提高,信用利差可能会进入下行通道,配置价值开始凸显。

股票市场上,考虑目前估值已经出现明显修复,虽然经济仍有下行压力,但伴随政策调控的转变,估值行情值得期待。我们继续坚持自下而上优中优选,围绕消费升级,优先选择行业发展空间大,持续增长动力强,增速较快的子行业,另外,也会继续关注行业集中度提高的龙头股机会。

在本基金的操作上,我们将继续坚持价值投资的理念,重视绝对收益目标,积极调整组合结构,控制组合下行风险,力争为投资者创造持续稳定的收益。

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:基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司2018年1月1日至2018年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:汇添富新睿精选灵活配置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	431,779.50	495,153.51
结算备付金	2,803,287.87	934,170.54
存出保证金	64,816.79	65,101.98
交易性金融资产	196,954,996.26	294,676,119.81
其中:股票投资	20,874,762.26	60,642,914.91
基金投资	-	-
债券投资	176,080,234.00	234,033,204.90
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	-	-
应收证券清算款	-	3,200,000.00
应收利息	2,930,783.19	4,911,966.13
应收股利	-	-
应收申购款	166,362.09	207,048.76
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	203,352,025.70	304,489,560.73
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	35,000,000.00	20,800,000.00
应付证券清算款	27,961.59	-
应付赎回款	154,339.28	3,464,551.32
应付管理人报酬	128,908.35	239,514.13
应付托管费	35,807.87	66,531.70
应付销售服务费	14,642.35	31,668.44
应付交易费用	72,623.72	45,332.19
应交税费	12,051.53	-
应付利息	-9,320.53	20,409.24
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	293,397.55	370,000.00
负债合计	35,730,411.71	25,038,007.02
所有者权益:		
实收基金	154,156,298.45	259,429,050.52
未分配利润	13,465,315.54	20,022,503.19
所有者权益合计	167,621,613.99	279,451,553.71
负债和所有者权益总计	203,352,025.70	304,489,560.73

注:报告截止日2018年6月30日,其中下属A类基金份额参考净值1.084元,份额总额113,407,548.11份;下属C类基金份额参考净值1.097元,份额总额40,748,750.34份。

6.2 利润表

会计主体:汇添富新睿精选灵活配置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	5,270,884.03	21,659,508.74
1.利息收入	3,702,652.85	12,970,100.83
其中:存款利息收入	23,046.01	4,150,018.34
债券利息收入	3,677,192.09	8,273,245.50
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,414.75	546,836.99
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	15,593,483.78	-2,907,442.95
其中:股票投资收益	17,096,773.95	-2,214,118.49
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,557,789.14	-1,360,068.34
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	54,498.97	666,743.88
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-14,082,847.49	10,486,664.92
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	57,594.89	1,110,185.94
减:二、费用	2,295,034.86	5,577,956.36
1. 管理人报酬	905,784.49	3,182,267.62
2. 托管费	251,606.81	883,963.19
3. 销售服务费	99,943.83	71,560.39
4. 交易费用	259,419.90	659,369.26
5. 利息支出	551,428.83	579,100.35
其中:卖出回购金融资产支出	551,428.83	579,100.35
6. 税金及附加	9,947.65	-
7. 其他费用	216,903.35	201,695.55
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	2,975,849.17	16,081,552.38

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富新睿精选灵活配置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)	259,429,050.52	20,022,503.19	279,451,553.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,975,849.17	2,975,849.17
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)	-105,272,752.07	-9,533,036.82	-114,805,788.89
其中:1.基金申购款	41,788,475.29	4,099,671.34	45,888,146.63
2.基金赎回款	-147,061,227.36	-13,632,708.16	-160,693,935.52
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)	154,156,298.45	13,465,315.54	167,621,613.99
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)	872,170,425.76	1,127,543.77	873,297,969.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	16,081,552.38	16,081,552.38
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)	-366,200,464.41	-3,253,231.05	-369,453,695.46
其中:1.基金申购款	60,128,463.05	347,986.94	60,476,449.99
2.基金赎回款	-426,328,927.46	-3,601,217.99	-429,930,145.45
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)	505,969,961.35	13,955,865.10	519,925,826.45

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

汇添富新睿精选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]1916号文《关于准予汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,并获中国证券监督管理委员会机构监管部函[2016]279号文《关于汇添富新睿精选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,由汇添富基金管理股份有限公司于2016年11月28日至2016年12月16日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第60466941_B22号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年12月21日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币871,991,150.99元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币179,274.77元。以上实收基金(本息)合计为人民币872,170,425.76元,折合872,170,425.76份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括依法发行上市的股票(包含中小板、创业板、其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、股指期货、股票期权、权证、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过积极主动的资产配置,充分挖掘各大类资产投资机会,力争实现积极资产的中长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%。

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 重要会计政策和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征增值税试点的通知》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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	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
东方证券股份有限公司	156,133,988.32	100.00%	454,240,841.82	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
东方证券股份有限公司	261,061,744.07	100.00%	407,493,262.18	100.00%

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 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	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
东方证券股份有限公司	2,296,700,000.00	100.00%	4,243,800,000.00	100.00%

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	144,720.10	100.00%	71,921.22	100.00%

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	419,955.19	100.00%	117,975.79	100.00%

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	905,784.49	3,182,267.62
其中:支付销售机构的客户维护费	273,376.53	1,537,734.31

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.90%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.90%÷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首日起3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

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	251,606.81	883,963.19

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。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首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 汇添富新睿精选混合A	汇添富新睿精选混合C	合计
中国农业银行股份有限公司	-	25,805.99	25,805.99
汇添富基金管理股份有限公司	-	68,646.48	68,646.48
东方证券股份有限公司	-	819.55	819.55
合计	-	95,272.02	95,272.02

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 汇添富新睿精选混合A	汇添富新睿精选混合C	合计
中国农业银行股份有限公司	-	51,557.71	51,557.71
汇添富基金管理股份有限公司	-	6,093.05	6,093.05
东方证券股份有限公司	-	2,132.85	2,132.85
合计	-	59,783.61	59,783.61

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提。

计算方法如下:

H=E×0.40%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算,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销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

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

注:本基金的基金管理人本报告期未及上年度末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去年末未投资本基金。

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 期末余额	当期利息收入	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
中国农业银行股份有限公司	431,779.50	8,023.30	1,081,768.29	41,550.90

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

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证券。

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,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币35,000,000.00元,于2018年7月2日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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	20,874,762.26	10.27
	其中:股票	20,874,762.26	10.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	176,080,234.00	86.59
	其中:债券	176,080,234.00	86.59
	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	-	-
	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	3,235,067.37	1.59
8	其他各项资产	3,161,962.07	1.55
9	合计	203,352,025.70	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	10,838,107.55	6.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	40,536.05	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	234,395.02	0.14
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	9,641,577.00	5.75
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	120,146.64	0.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	20,874,762.26	12.45

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股票投资。

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股票投资明细

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	600436	片仔癀	33,000	3,693,690.00	2.20
2	000651	格力电器	76,700	3,616,405.00	2.16
3	600867	通化东宝	142,909	3,425,528.73	2.04
4	601318	中国平安	55,600	3,257,048.00	1.94
5	600036	招商银行	121,100	3,201,884.00	1.91
6	601939	建设银行	485,900	3,182,645.00	1.90
7	601828	美凯龙	7,863	120,146.64	0.07
8	603056	德邦股份	4,146	113,558.94	0.07
9	601326	秦港股份	21,442	87,054.52	0.05
10	603619	中曼石油	1,760	57,147.20	0.03

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	600436	片仔癀	5,842,884.00	2.09
2	002258	利尔化学	4,283,078.00	1.53
3	000786	北新建材	4,140,748.80	1.48
4	002027	分众传媒	3,901,176.00	1.40
5	600486	扬农化工	3,894,530.00	1.39
6	603658	安图生物	3,890,975.90	1.39
7	601877	正泰电器	3,867,677.50	1.38
8	600867	通化东宝	3,852,197.60	1.38
9	000651	格力电器	3,702,106.00	1.32
10	601939	建设银行	3,459,608.00	1.24
11	601318	中国平安	3,458,947.00	1.24
12	600036	招商银行	3,457,330.00	1.24
13	600622	光大嘉宝	3,040,723.80	1.09
14	300003	乐普医疗	2,825,769.00	1.01
15	600426	华鲁恒升	1,998,038.00	0.71
16	600048	保利地产	1,936,680.00	0.69
17	601828	美凯龙	80,438.49	0.03
18	603056	德邦股份	20,066.64	0.01
19	603356	华菱精工	12,650.19	0.00

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	601318	中国平安	12,048,085.00	4.31
2	600519	贵州茅台	11,636,323.00	4.16
3	603658	安图生物	8,206,084.20	2.94
4	601939	建设银行	7,819,640.62	2.80
5	600036	招商银行	7,463,716.70	2.67
6	600426	华鲁恒升	6,623,811.75	2.37
7	600660	福耀玻璃	6,422,090.89	2.30
8	600486	扬农化工	4,749,483.57	1.70
9	002258	利尔化学	4,507,770.38	1.61
10	600436	片仔癀	4,337,539.50	1.55
11	000786	北新建材	4,145,085.00	1.48
12	600297	广汇汽车	4,005,871.82	1.43
13	601877	正泰电器	3,911,397.00	1.40
14	002027	分众传媒	3,564,058.00	1.28
15	300003	乐普医疗	3,262,028.84	1.17
16	600622	光大嘉宝	2,947,002.70	1.05
17	600048	保利地产	1,837,217.00	0.66
18	600867	通化东宝	1,094,312.75	0.39

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	57,665,624.92
卖出股票收入(成交)总额	98,581,518.72

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	10,837,200.00	6.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,487,000.00	6.26
	其中:政策性金融债	10,487,000.00	6.26
4	企业债券	143,575,261.20	85.65
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	11,180,772.80	6.67
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	176,080,234.00	105.05

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	189917	18贴现国债17	110,000	10,837,200.00	6.47
2	180205	18国开05	100,000	10,487,000.00	6.26
3	143570	18兵器01	100,000	10,018,000.00	5.98
4	143079	17信投G1	100,000	9,982,000.00	5.96
5	143355	17国控01	100,000	9,972,000.00	5.95

7.7 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。

7.8 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

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	64,816.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,930,783.19
5	应收申购款	166,362.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,161,962.07

7.12.4 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	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110032	三一转债	3,682,200.00	2.20
2	113014	林洋转债	1,823,750.40	1.09
3	113015	隆基转债	1,733,200.00	1.03
4	132005	15国资EB	1,262,531.90	0.75
5	128016	雨虹转债	1,245,840.00	0.74
6	110034	九州转债	659,375.00	0.39
7	113013	国君转债	410,305.50	0.24
8	128029	太阳转债	363,570.00	0.22

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 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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
汇添富新睿精选混合A	2,205	51,431.99	197,637.46	0.17%	113,209,910.65	99.83%
汇添富新睿精选混合C	7,825	5,207.51	100,004.50	0.25%	40,648,745.84	99.75%
合计	10,030	15,369.52	297,641.96	0.19%	153,858,656.49	99.81%

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	汇添富新睿精选混合A	1,100.00	0.00%
	汇添富新睿精选混合C	56,480.41	0.14%
	合计	57,580.41	0.04%

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	汇添富新睿精选混合A	0
	汇添富新睿精选混合C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富新睿精选混合A	0
	汇添富新睿精选混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富新睿精选混合A	汇添富新睿精选混合C
基金合同生效日(2016年12月21日)基金份额总额	812,789,753.49	59,380,672.27
本报告期期初基金份额总额	184,402,234.86	75,026,815.66
本报告期基金总申购份额	4,993,259.06	36,795,216.23
减:本报告期基金总赎回份额	75,987,945.81	71,073,281.55
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	113,407,548.11	40,748,750.34

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,聘任茹奕蕾为汇添富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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
东方证券	2	156,133,988.32	100.00%	144,720.10	100.00%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-
华泰证券	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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	261,061,744.07	100.00%	2,296,700,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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:华泰证券(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