汇添富沪港深大盘价值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2月18日(基金合同生效日)起至6月30日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	添富沪港深大盘价值混合
基金主代码	005504
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月13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	3,526,996,837.54份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	本基金采用自下而上的投资方法,以深入的基本面分析为立足点,精选价值被低估、具备长期稳定增长能力的大盘价值型股票,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金。投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险;个股精选策略用于挖掘优质的大盘价值型股票。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*15%+恒生指数收益率*(使用估值汇折算)*65%+中债综合财富指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险收益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。 本基金将投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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号银且国际大楼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2月13日-2018年6月30日)
本期已实现收益	-35,512,455.52
本期利润	-89,271,249.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0230
本期基金份额净值增长率	-2.58%
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	-0.0258
期末基金资产净值	3,436,055,529.46
期末基金份额净值	0.9742

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.所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。

4.本基金的《基金合同》生效日为2018年02月18日,至本报告期末未满一年,因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2018年06月30日数据,特此说明。

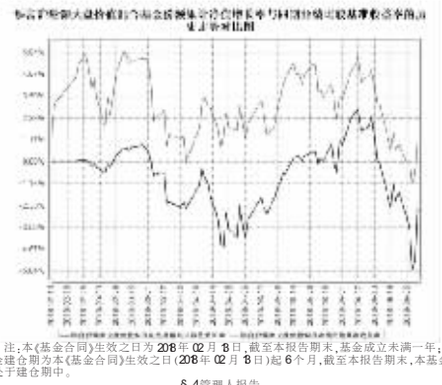
3.2基金净值表现

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	-3.64%	1.20%	-2.32%	0.94%	-1.32%	0.26%
过去三个月	-0.31%	0.97%	-0.30%	0.88%	-0.01%	0.09%
自基金合同生效日起至今	-2.58%	0.82%	1.06%	0.91%	-3.64%	-0.09%

注:本基金的《基金合同》生效日为2018年02月18日,至本报告期末未满半年。

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《基金合同》生效之日为2018年02月18日,截至本报告期末,基金成立未满一年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2018年02月18日)起6个月,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

§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12,724,224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428.15亿元,有效客户数约988万户,资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理10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、汇添富价值精选混合型证券投资基金、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、汇添富监管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7日红利宝货币市场基金、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、汇添富产源200定增中证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、汇添富添通货币市场基金、汇添富全瑞宝货币市场基金、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、汇添富品质纯钱货币市场基金、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、汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金、汇添富精选美元债债券型证券投资基金、汇添富鑫证定期开放债券型证券投资基金、汇添富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、汇添富鑫宜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。

4.2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		
陈健玮	添富沪港深大盘价值混合的基金经理	2018年2月13日	-	8年	国籍:中国香港;学历:香港大学土木工程学士,中欧国际工商学院工商管理硕士(MBA)。相关从业资格:证券投资基金从业资格。曾任德勤·关黄陈方会计师行(香港)环球金融服务组审计师,国投瑞银基金管理有限公司国际业务部研究员,投资经理助理,投资经理,博时基金管理有限公司投资经理,2017年4月加入汇添富基金管理股份有限公司,2018年2月13日至今任添富沪港深大盘价值混合的基金经理。
旁杰男	汇添富价值精选混合基金、添富沪港深大盘价值混合基金的基金经理,研究副总监。	2018年2月13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

回顾上半年,港股市场经历了比较大的波动,总体由去年的低波动趋势向上的市场转变为大幅震荡的市场环境。港股市场在一月份出现大幅上涨,由金融、房地产、能源和资讯科技类股票领涨,但后续市场受到全球主要市场下跌、金融去杠杆、美联储加息步伐加快、贸易摩擦、人民币走势等多方因素影响下,市场出现震荡下行的走势,市场在四月初到六月中一直处于区间波动,六月中下旬因中美贸易摩擦加剧等事件,明显影响了市场情绪,导致恒生指数在内的重要港股指数在六月底创下了上半年的的新低。行业方面,上半年医药、食品饮料、能源、公用事业、教育等板块表现较好,而非银金融、电信服务、汽车、硬件等表现较差。一季度表现较好的房地产、银行和原材料板块,却在二季度出现了较弱的走势。估值方面,恒生指数和恒生国企指数目前的估值水平相比全球主要的发达市场和新兴市场来说,仍然处于较低水平,经过这轮回调和企业盈利的增长,目前恒生指数的预测市盈率已经回到接近2016年底时的水平。

本基金在二季度增持了一部分成立,仍处于建仓期,基于对当前市场估值和未来后市的判断,大盘价值基金在二季度择机并逐步提高仓位,并强调"行业相对均衡、个股适度集中、适时动态调整"的思路。本基金的配置方面以大盘股为主,主要是因为在金融去杠杆的背景下,不少行业在经历行业整合和集中度提升的过程,这将有利于该行业中的龙头企业获得市场份额和盈利的提升,我们对于优质的中国企业的盈利前景较有信心,因此认为港股市场中的优秀上市企业仍然存在中长期估值修复和扩张的机会。本基金注重行业的均衡配置,目前以医药、消费、资讯科技和金融为核心板块,并适当配置公用事业、能源、房地产等板块。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.9742元;本报告期基金份额净值增长率为-2.58%,业绩比较基准收益率为1.06%。

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,中美贸易摩擦、财政和货币政策、人民币走势、宏观经济数据等因素将持续影响港股市场,我们会密切关注,并动态调整组合。宏观经济方面,我们认为在适度宽松的货币政策和积极的财政政策支持下,宏观经济情况将趋于稳定,结构升级转型将持续进行。贸易摩擦方面,目前中美均处于贸易摩擦的直接交锋阶段,预计后续将有更多的反复谈判进行,因此我们仍然需要关注事态的发展,但市场开始对贸易摩擦的信息有所钝化。

操作方面,本基金将坚持"行业相对均衡、个股适度集中、适时动态调整"的思路,自下而上优选具有竞争优势的企业,并注重企业的中长期投资价值,立足长远。行业配置方面,本基金将持续以医药、消费、资讯科技和金融为核心板块,并适当配置公用事业、能源、房地产等板块。我们将聚焦于消费升级、高端制造、行业整合、科技创新等领域,并挖掘当中具有长期投资价值和竞争优势、估值合理的行业龙头企业,此外,我们将持续挖掘拥有较吸引风险收益比的价值型企业进行投资。

总体而言,今年市场预计仍然较为波动,但我们相信市场依然存在结构性的机会,配置优秀的企业是获得长期稳定收益的有效方法。

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》)同时度止)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,可以提议调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,保证基金估值的公正、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:1.本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

2.基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期未进行利润分配。

4.8投资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沪港深大盘价值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,汇添富沪港深大盘价值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沪港深大盘价值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,汇添富沪港深大盘价值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沪港深大盘价值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:汇添富沪港深大盘价值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
资产:	
银行存款	417,788,354.17
结算备付金	179,511,127.22
存出保证金	956,246.97
交易性金融资产	2,869,514,351.25
其中:股票投资	2,869,514,351.25
基金投资	-
债券投资	-
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	99,910,169.96
应收证券清算款	-
应收利息	142,771.76
应收股利	10,625,728.25
应收申购款	473,942.98
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	3,578,922,692.56
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30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	122,649,719.36
应付赎回款	12,023,023.53
应付管理人报酬	4,464,528.03
应付托管费	744,088.00
应付销售服务费	-
应付交易费用	2,788,479.76
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	197,324.42
负债合计	142,867,163.10
所有者权益:	
实收基金	3,526,996,837.54
未分配利润	-90,941,308.08
所有者权益合计	3,436,055,529.46
负债和所有者权益总计	3,578,922,692.56

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.9742元,基金份额总额3,526,996,837.54份。

6.2利润表

会计主体:汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金
本报告期:2018年2月18日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年2月13日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入	-53,450,434.58
1.利息收入	14,755,328.02
其中:存款利息收入	13,305,839.56
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,449,488.46
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-16,060,354.58
其中:股票投资收益	-41,949,347.80
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	25,888,993.22
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-53,758,794.42
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,613,386.40
减:二、费用	35,820,815.36
1.管理人报酬	21,741,115.39
2.托管费	3,623,519.20
3.销售服务费	-
4.交易费用	10,284,667.58
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.税金及附加	-
7.其他费用	171,513.19
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-89,271,249.94

注:本基金合同于2018年2月18日生效,无比较式的上年度可比期间,因此利润表只列示2018年2月18日(基金合同生效日)至2018年06月30日数据,特此说明。

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金
本报告期:2018年2月18日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年2月13日(基金合同生效日)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)	4,054,145,142.58	-	4,054,145,142.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期净利润)	-	-89,271,249.94	-89,271,249.94
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)	-527,148,305.04	-1,670,058.14	-528,818,363.18
其中:1.基金申购款	24,727,569.15	-278,119.13	24,449,450.02
2.基金赎回款	-551,875,874.19	-1,391,939.01	-553,267,813.20
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)	3,526,996,837.54	-90,941,308.08	3,436,055,529.46

注:本基金合同于2018年2月18日生效,无比较式的上年度可比期间,因此所有者权益(基金净值)变动表只列示2018年2月18日(基金合同生效日)至2018年6月30日数据,特此说明。

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

汇添富沪港深大盘价值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[2017]2258号文《关于准予汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由汇添富基金管理股份有限公司于2018年1月15日至2018年2月8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(2018)验字第60468941_B03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2018年2月18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4,052,343,417.77元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币1,801,728.81元,以上实收基金(本息)合计为人民币4,054,145,142.58元,折合4,054,145,142.58份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、股票期权、国债期货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。本基金采用自下而上的投资方法,以深入的基本面分析为立足点,精选价值被低估、具备长期稳定增长能力的大盘价值型股票,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金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*15%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*65%+中债综合财富指数收益率*20%。

6.4.2会计报表的编制基础

本财务报表按照财政部颁布的《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2月18日(基金合同生效日)至2018年6月30日止期间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

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年自1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2018年2月18日(基金合同生效日)起至2018年6月30日止。

6.4.4.2记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和债券投资等;

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票及债券等,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4)股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认;

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益,股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转;

(5)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(6)回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价;

(2)不存在活跃市场的金融工具,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值;

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(4)如有新增事项,按国家最新规定估值。

6.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

6.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包