汇添富盈润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:中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	添富盈润混合	
基金主代码	004946	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年9月6日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	116,563,771.95份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	添富盈润混合A	添富盈润混合C
下属分级基金的交易代码:	004946	004947
报告期末下属分级基金的份额总额	105,297,165.86份	11,266,606.09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,通过积极主动的管理,追求基金资产的长期稳定回报。
投资策略	本基金在保证资产配置符合基金合同规定的前提下,采用CPPI(Constant Proportion Portfolio Insurance)策略进行组合保险策略来实现本金保值和增值的目标。CPPI策略主要根据市场的波动来调整,修正风险类资产的风险乘数,以确保投资组合在一段时间以后的价值不低于事先设定的某一目标价值,从而达到投资组合保值增值的目的。投资过程中,基金管理人将在风险类资产投资风险加大和收益增速两者之间寻找适当的平衡点,即确定适当的风险乘数,力求既能够保证投资组合风险可控,又能够尽量地为投资者创造更多收益。 本基金的投资策略主要包含资产配置策略、债券投资策略和股票投资策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*20%+中债综合指数收益率*80%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金,低于股票型基金,属于中等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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	田青
	联系电话	021-28932888	010-67595096
	电子邮箱	service@99fund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-9918	010-67595096
传真		021-28932998	010-66275853

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	添富盈润混合A	添富盈润混合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	13,170,753.02	1,032,541.62
本期利润	4,530,181.63	83,921.75
加权平均基金份额本期利润	0.0316	0.0064
本期基金份额净值增长率	-1.13%	-1.53%
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	0.0454	0.0373
期末基金资产净值	110,073,453.48	11,686,321.02
期末基金份额净值	1.0454	1.0373

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。

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

添富盈润混合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	-1.17%	0.50%	-1.26%	0.25%	0.09%	0.25%
过去三个月	-0.75%	0.55%	-1.18%	0.23%	0.43%	0.32%
过去六个月	-1.13%	0.64%	-0.85%	0.23%	-0.28%	0.41%
自基金合同生效日起至今	4.54%	0.59%	-0.83%	0.20%	5.37%	0.39%

添富盈润混合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	-1.21%	0.50%	-1.26%	0.25%	0.05%	0.25%
过去三个月	-0.84%	0.55%	-1.18%	0.23%	0.34%	0.32%
过去六个月	-1.53%	0.64%	-0.85%	0.23%	-0.68%	0.41%
自基金合同生效日起至今	3.73%	0.58%	-0.83%	0.20%	4.56%	0.38%

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2017年09月06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(2017年09月06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1988万户,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、汇添富收益快线货币市场基金、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(LOF)、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
何旻	汇添富安心中国债券基金、汇添富6月红定期开放债券基金、汇添富盈鑫保本混合基金、汇添富美元债债券(QDII)基金、添富添福吉祥混合基金、添富盈润混合基金、汇添富弘安混合基金的基金经理。	2017年9月6日	-	20年	国籍:中国。学历:美国伦敦政治经济学院金融经济学硕士。相关业务资格:基金从业资格,特许金融分析师(CFA),财务风险经理人(FRM)。从业经历:曾任国泰基金管理有限公司行业研究员、综合研究小组负责人、基金经理助理、固定收益部负责人;金元比联基金管理有限公司基金经理,2004年10月28日至2006年11月11日担任国泰金龙债券基金的基金经理,2005年10月27日至2006年11月11日担任国泰金象保本基金的基金经理,2006年4月28日至2006年11月11日担任国泰金鹿保本基金的基金经理,2007年8月15日至2010年12月29日担任金元比联宝石动力双利债券基金的基金经理,2008年9月3日至2009年3月10日担任金元比联成长动力混合基金的基金经理,2009年3月29日至2010年12月29日担任金元比联丰利债券基金的基金经理。2011年1月加入汇添富资产管理(香港)有限公司,2012年2月17日至今任汇添富人民币债券基金的基金经理,2012年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,2013年11月22日至今任汇添富安心中国债券基金的基金经理,2014年1月21日至今任汇添富6月红定期开放债券基金(曾任汇添富信用债债券基金)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;2017年4月20日至今任汇添富美元债债券(QDII)基金的基金经理,2017年7月24日至今任添富添福吉祥混合基金的基金经理,2017年9月6日至今任添富盈润混合基金的基金经理,2017年9月29日至今任汇添富弘安混合基金的基金经理。
胡昕炜	汇添富消费行业混合基金、添富添福吉祥混合基金、添富盈润混合基金、添富创造定开混合基金的基金经理。	2017年9月20日	-	7年	国籍:中国。学历:清华大学工学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2011年加入汇添富基金任行业分析师,2016年4月8日至今任汇添富消费行业混合基金的基金经理,2017年7月28日至今任添富添福吉祥混合基金的基金经理,2017年9月20日至今任添富盈润混合基金的基金经理,2018年1月19日至今任添富创造定开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

2018年上半年消费物价指数CPI基本运行在低位,仅在春节期间反弹至2.90%。去除了食品和能源价格之后的核心CPI在2.0%上下窄幅波动,6月核心CPI回落至1.90%,为自2017年3月以来的低点。上半年的生产物价指数PPI呈现U形趋势,在3月份达到最低点3.10%后开始反弹,在6月份达到4.70%。这一趋势与中国制造业采购经理指数PMI指数趋势方向基本一致。PMI指数最低点出现在2月份,4.6月份亦有所反弹,其中的生产分项指数和新订单指数都呈现上升趋势。宏观基本面数据在今年第一季度有回暖趋势,在第二季度回落。投资数据方面,固定资产投资、房地产投资和基础设施建设投资都呈现了N型走势,同比增速在2.3月份达到上半年高点后,在二季度都有所回落。民间固定资产投资和制造业投资累计同比增速在6月份出现反弹。从房地产的细项数据上看,70个大中城市商品房价格指数基本保持平稳。销售额、销售面积和新开工面积的累计增速在二季度逐月上升,呈现回暖的趋势。货币政策方面,央行通过公开市场操作在第一季度回笼9600亿元,第二季度投放货币3400亿元。M1同比增速在二季度仍然在下降,6月份增速为近三年来的低点。M2同比增速仍然在低位徘徊。整个债券市场在上半年呈现资金宽松的局面,只是在5月底短暂出现资金紧张局面。人民币兑美元汇率在第二季度走势与第一季度相反,出现贬值。至6月底,人民币兑美元汇率基本与去年2月底汇率持平。第二季度各月份的外汇占款增加额较第一季度有所上升,在5月份达到91亿元。

上半年,债券市场受到降准政策的刺激,经济基本面的预期,以及资金面宽松等因素的影响,中债综合财富指数上涨3.67%。月度表现上,每个月都是正回报,呈现单边上扬的格局,股票市场,上半年沪深300指数下跌2.90%,指数在1月26日创出近2年多来的新高后,逐级回落,在6月28日创出近1年多来的新低。

本基金在上半年,第一季度主要是对股票进行了结构调整,第二季度降低了股票的整体比例。债券方面主要是增加组合的杠杆,买入了中等期限的公司债或者中票,卖出组合中资质较低的信用债。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末添富盈润混合A基金份额净值为1.0454元,本报告期基金份额净值增长率为-1.13%;截至本报告期末添富盈润混合C基金份额净值为1.0373元,本报告期基金份额净值增长率为-1.53%,同期业绩比较基准收益率为-0.85%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年下半年经济增长仍然面临一定的不确定性,一方面是去杠杆带来的信用收缩,另一方面因贸易战带来的外需走弱。在一系列监管政策的影响下,实体去杠杆取得了成效,但由同时带来了经济增长的下行压力。去杠杆的负面影响已经开始显现,6月底召开的央行二季度货币政策例会中,央行提出"把握好结构性去杠杆的力度和节奏",从宏观看来,目前社融余额增速已经接近名义GDP增速,继续降低可能会使得实体合理融资需求无法获得满足,与年初设定的"保持信贷和社会融资规模合理增长"目标相悖,陷入紧缩式去杠杆的境地。从微观看来,企业再融资成本和压力快速上升,使得信用紧缩成为当前经济下行的主要风险。中美贸易战已经开始,意味着外需对经济拉动能力将进一步走弱。7年净出口对国内GDP的贡献度达到0.6个百分点,为近年来的最高值,全球经济的同步复苏是外需改善的主要原因。但8年以来,同步复苏正向着复苏分化的状态转变,仅有美国保持良好的增长态势,欧元区景气度开始明显放缓,新兴市场面临较大的资本外流压力。美国经济的"一枝独秀"意味着其开始成为全球需求的主要来源,而特朗普政府的贸易保护主张则恰恰仰仗于这种优势,随着中美贸易战的正式开打,下半年外需对国内经济的拉动作用将会逐步下降。

紧信用带来经济下行叠加外需走弱,我们预期经济政策都将发生变化。国内的信用环境不佳,继续紧化空间有限,紧信用的政策底或已出现;货币政策基调进一步转向宽松,央行第二季度两次降准或因改善银行体系的信贷投放能力;除此,央行将降准释放的约5000亿的流动性用于"债转股",以促进地方国企降低负债率。外部政策方面,我们预计央行对汇率波动的容忍度加强,以对冲加征关税的影响。总体,今后政策组合拳将由"稳信用"、"宽货币"、"债转股"去杠杆、地方政府债务化解和人民币汇率小幅贬值组成。预计宽松的资金面带来短端收益率下降,宏观经济的压力仍然利好债券收益率的继续下行,预计年内收益率中枢仍有继续向下的空间。对信用债而言,未来不同评级债券间的信用利差将继续走阔。

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,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对应类别的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。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该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期末进行利润分配。

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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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:汇添富盈润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	408,480.89	1,951,987.59
结算备付金	999,383.65	2,310,523.32
存出保证金	51,541.76	75,240.61
交易性金融资产	119,430,644.47	363,870,286.48
其中:股票投资	25,607,366.16	112,614,398.38
基金投资	-	-
债券投资	93,823,278.31	251,255,888.10
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	-	3,091,148.74
应收利息	2,229,432.66	2,224,050.54
应收股利	-	-
应收申购款	64,183.10	127,893.43
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	123,183,666.53	373,651,130.71
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	1,000,000.00	21,000,000.00
应付证券清算款	797.26	-
应付赎回款	45,300.73	3,384,182.33
应付管理人报酬	103,817.16	324,239.63
应付托管费	25,954.31	81,059.91
应付销售服务费	3,904.14	8,401.01
应付交易费用	33,720.76	246,972.14
应交税费	7,011.61	-
应付利息	-265.76	-7,883.40
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	203,651.82	208,470.51
负债合计	1,423,892.03	25,245,442.13
所有者权益:		
实收基金	116,563,771.95	329,608,543.12
未分配利润	5,196,002.55	18,797,145.46
所有者权益合计	121,759,774.50	348,405,688.58
负债和所有者权益总计	123,183,666.53	373,651,130.71

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10454元,份额总额105,297,165.86份;下属C类基金份额参考净值10373元,份额总额11,266,606.09份。

6.2利润表

会计主体:汇添富盈润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
一、收入	6,390,673.96
1.利息收入	2,034,381.10
其中:存款利息收入	25,367.50
债券利息收入	2,009,013.60
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	13,442,826.61
其中:股票投资收益	15,466,910.20
基金投资收益	-
债券投资收益	-2,515,177.81
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	491,094.22
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-9,589,191.26
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	502,657.51
减:二、费用	1,776,570.58
1.管理人报酬	831,150.02
2.托管费	207,787.56
3.销售服务费	27,555.74
4.交易费用	194,856.03
5.利息支出	321,343.43
其中:卖出回购金融资产支出	321,343.43
6.税金及附加	5,354.37
7.其他费用	188,523.43
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	4,614,103.38

注:本基金合同于2017年09月06日生效,无比较式的上年度可比期间,因此利润表只列示本期数据,特此说明。

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富盈润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)	329,608,543.12	18,797,145.46	348,405,688.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,614,103.38	4,614,103.38
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)	-213,044,771.17	-18,215,246.29	-231,260,017.46
其中:1.基金申购款	18,784,919.75	1,584,190.22	20,369,109.97
2.基金赎回款	-231,829,690.92	-19,799,436.51	-251,629,127.43
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)	116,563,771.95	5,196,002.55	121,759,774.50

注:本基金合同于2017年9月6日生效,无比较式的上年可比期间,因此所有者权益(基金净值)变动表只列示本期数据,特此说明。

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

汇添富盈润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]784号文《关于准予汇添富盈润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2017年8月7日至2017年9月1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(2017)验字第60466941_B32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2017年9月6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646,701,966.42元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币263,325.55元,以上实收基金(本息)合计为人民币646,965,291.97元,折合646,965,291.97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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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)、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、政府支持债券、政府支持机构债券、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)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的管理,追求基金资产的长期稳定回报。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%。

6.4.2会计政策的编制基础

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[2008]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