汇添富盈鑫保本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。

本报告中财务资料未经审计。

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	汇添富盈鑫保本混合
基金主代码	002420
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月11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	1,901,987,752.28份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资组合保险技术来运作,在保证本金安全的前提下,力争在保本期内实现基金财产的稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合,利用组合保险技术,动态调整安全资产与风险资产的投资比例,以确保基金在保本期期到期时,实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。安全资产主要包括国债、央行票据、银行存款等品种。风险资产主要包括股票、权证、股指期货等品种。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税后)。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。 投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构。保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

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	98,400,297.24
本期利润	12,744,722.21
加权平均基金份额本期利润	0.0052
本期基金份额净值增长率	0.00%
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	0.0732
期末基金资产净值	2,041,132,613.77
期末基金份额净值	1.073

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。

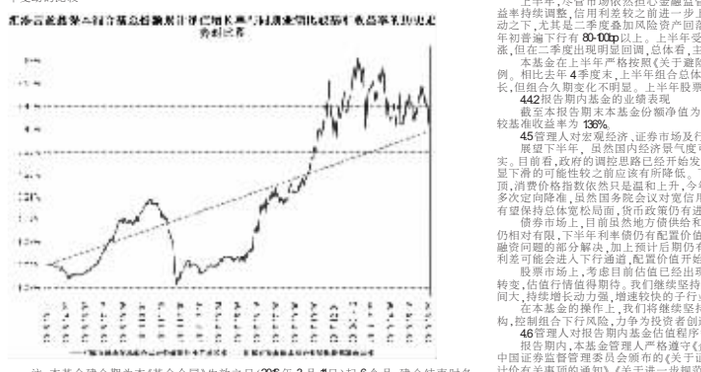
3.2基金净值表现

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	-0.09%	0.26%	0.23%	0.01%	-0.32%	0.25%
过去三个月	0.00%	0.29%	0.69%	0.01%	-0.69%	0.28%
过去六个月	0.00%	0.32%	1.36%	0.01%	-1.36%	0.31%
过去一年	4.28%	0.28%	2.75%	0.01%	1.53%	0.27%
自基金合同生效日起至今	7.30%	0.20%	6.34%	0.01%	0.96%	0.19%

注:本基金的《基金合同》生效日为2016年3月11日,至本报告期末未满3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:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2016年3月11日)起6个月,建仓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62,724,224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428.5亿元,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、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、汇添富稳煤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、汇添富照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。

4.2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		
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。	2016年3月11日	-	20年	国籍:中国。学历:英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、综合研发小组负责人、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(原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日至今任汇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。				
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、汇添富鑫泽定开债券基金的基金经理。汇添富增强收益债券基金的基金经理助理。	2016年3月11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券基金的基金经理。				

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.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,本基金的基金经理何旻先生继续管理本基金。

4.2管理人对投资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管理人对投资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,形成制度式基金、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同比增速向可,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,受美国对伊朗核草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GDP前期受基数和春节错位影响,同比增速出现反弹,但后期因需求不许,持续推持低位,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、信用负面收缩担忧,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有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。

本基金在"以严格执行基金合同为原则,以严格控制风险为前提,控制风险管理的配置比例。相比去年4季度末,上半年组合总体是适度增加了债券稳健资产的配置比例,久期也略有拉长,但组合久期变化不明显。上半年股票仓位变化不大,总体保持稳定。

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1.073元;本报告期基金份额净值增长率为0.00%,业绩比较基准收益率为1.36%。

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,经济总体维持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,虽然国务院公开对宽信用释放出明显的政策信号,地方债供给会增加,但资金面有望保持总体宽松局面,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亦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,相对现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》以及中国证监会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,均具有较为丰富的证券、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:在复核相关基金分红条件的前提下,保本周期内,基金分红仅采取现金分红一种收益分配方式;基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算,可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准;基金收益分配后,基金份额净值不得低于面值。

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

本报告期内,本基金托管人在对汇添富盈鑫保本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,汇添富盈鑫保本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盈鑫保本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,汇添富盈鑫保本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盈鑫保本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:汇添富盈鑫保本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	2,231,076.99	32,656,860.67
结算备付金	42,000,923.23	26,664,705.14
存出保证金	217,630.94	329,163.12
交易性金融资产	2,696,304,493.44	4,175,970,867.22
其中:股票投资	274,521,448.01	563,497,168.92
基金投资	-	-
债券投资	2,421,783,045.43	3,612,473,698.30
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	2,919,243.18	169,337,864.79
应收利息	33,848,803.85	58,152,988.97
应收股利	-	-
应收申购款	4,361.70	981,774.48
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,777,526,533.33	4,464,094,224.39
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	730,500,000.00	1,034,500,000.00
应付证券清算款	-	169,990,917.17
应付赎回款	3,048,062.86	2,349,301.15
应付管理人报酬	2,078,981.54	3,340,987.46
应付托管费	346,496.90	556,831.23
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	195,790.88	149,404.80
应交税费	154,527.26	-
应付利息	-193,585.60	106,620.81
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	263,645.72	367,783.27
负债合计	736,393,919.56	1,211,361,845.89
所有者权益:		
实收基金	1,901,987,752.28	3,032,243,021.91
未分配利润	139,144,861.49	220,489,356.59
所有者权益合计	2,041,132,613.77	3,252,732,378.50
负债和所有者权益总计	2,777,526,533.33	4,464,094,224.39

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.073元,基金份额总额1,901,987,752.28份。

6.2利润表

会计主体:汇添富盈鑫保本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	48,299,392.35	181,337,810.50
1.利息收入	52,119,320.00	100,283,116.21
其中:存款利息收入	383,248.24	18,808,822.29
债券利息收入	51,676,190.83	81,389,377.81
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	59,880.93	84,916.11
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	81,339,060.16	-61,286,241.82
其中:股票投资收益	85,553,109.90	18,878,730.07
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-10,017,536.34	-82,184,410.19
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	5,803,486.60	2,019,438.30
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-85,655,575.03	139,704,424.22
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	496,587.22	2,636,511.89
减:二、费用	35,554,670.14	49,452,103.36
1.管理人报酬	15,800,205.35	25,447,570.55
2.托管费	2,633,367.58	4,241,261.74
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	924,842.37	1,150,213.91
5.利息支出	15,884,423.64	18,402,783.46
其中:卖出回购金融资产支出	15,884,423.64	18,402,783.46
6.税金及附加	125,386.63	-
7.其他费用	186,444.57	210,273.70
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	12,744,722.21	131,885,707.14

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富盈鑫保本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)	3,032,243,021.91	220,489,356.59	3,252,732,378.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,744,722.21	12,744,722.21
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)	-1,130,255,269.63	-94,089,217.31	-1,224,344,486.94
其中:1.基金申购款	8,668,712.96	740,197.22	9,408,910.18
2.基金赎回款	-1,138,923,982.59	-94,829,414.53	-1,233,753,397.12
四、本期向基金分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)	1,901,987,752.28	139,144,861.49	2,041,132,613.77

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)	4,466,254,119.13	-14,355,404.24	4,451,898,714.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	131,885,707.14	131,885,707.14
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)	-536,295,844.88	-3,214,870.86	-539,510,715.74
其中:1.基金申购款	1,660,863.86	16,013.58	1,676,877.44
2.基金赎回款	-537,956,708.74	-3,230,884.44	-541,187,593.18
四、本期向基金分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)	3,929,958,274.25	114,315,432.04	4,044,273,706.29

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

汇添富盈鑫保本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[2016]94号文《关于准予汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金注册的批复》的准予注册,由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2016年3月11日正式生效,首次设立募集规模为4,849,549,217.33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和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(包括中小板、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(含分离交易可转换债券)、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)、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、股票期权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)。本基金参与融资业务。本基金主要通过投资组合保险技术来运作,在保证本金安全的前提下,力争在保本期内实现基金财产的稳健增值。本基金业绩比较基准:三年期银行定期存款收益率(税后)。

6.4.2会计报表的编制基础

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《关于进一步明确金融批发或零售的通知》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纳税人,按照现行增值税税率缴纳增值税;

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情况,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