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 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:招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及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。

基金托管人招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、净值表现和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。

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	汇添富绝对收益定开混合
基金主代码	000762
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年 3 月 15 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	231,046,361.12 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	基于基金管理人对市场机会的判断,灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略,在严格的风险管理下,追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。
投资策略	本基金采用包括市场中性投资策略在内的多种绝对收益策略,力争实现基金资产长期持续稳定的绝对回报。
业绩比较基准	一年期定期存款税后利率。
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金,采用多种绝对收益策略,其中市场中性策略采用股指期货对冲市场风险,使得收益波动与市场相关性较低。因此,本基金属于中低风险水平追求绝对收益的投资品种,其预期风险低于股票型基金和一般的混合型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	张燕
	联系电话	021- 28932888	0755- 83199084
	电子邮箱	service@99fund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400- 888- 9918	95555
传真		021- 28932998	0755- 83195201

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	29,411,875.45
本期利润	18,625,514.77
加权平均基金份额本期利润	0.0719
本期基金份额净值增长率	6.54%
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	0.1566
期末基金资产净值	267,281,119.26
期末基金份额净值	1.157

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

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	0.17%	0.44%	0.12%	0.00%	0.05%	0.44%
过去三个月	3.86%	0.38%	0.37%	0.00%	3.49%	0.38%
过去六个月	6.54%	0.41%	0.74%	0.00%	5.80%	0.41%
过去一年	13.77%	0.41%	1.50%	0.00%	12.27%	0.41%
自基金合同生效日起至今	15.70%	0.37%	1.94%	0.00%	13.76%	0.37%

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(2017 年 3 月 15 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、汇添富益安保本混合型证券投资基金、汇添富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
姚耀强	汇添富策略回报混合基金、汇添富趋势投资混合基金、汇添富沪港深新价值股票基金、汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理。	2017年 3 月 15 日	-	14年	国籍:中国。学历:清华大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任高级行业分析师、基金经理助理。2009 年 12 月 22 日至今任汇添富策略回报混合基金的基金经理,2012 年 3 月 9 日至今任汇添富逆向投资混合基金的基金经理,2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日任汇添富均衡增长混合基金的基金经理,2016 年 7 月 27 日至今任汇添富沪港深新价值股票基金的基金经理,2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理。
吴江宏	汇添富可转换债券基金、汇添富盈安保本混合基金、汇添富稳健保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富鑫利债券基金、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富鑫汇定开债券基金、汇添富民丰回报混合、添富鑫永定开债、添富鑫盛定开债的基金经理。	2017年 3 月 15 日	-	7年	国籍:中国。学历:厦门大学经济学硕士。2011 年加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益分析师。2015 年 7 月 17 日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理。2016 年 4 月 19 日至今任汇添富盈安保本混合基金的基金经理。2016 年 8 月 3 日至今任汇添富稳保本混合基金的基金经理。2016 年 9 月 29 日至今任汇添富鑫保本混合基金的基金经理。2017 年 3 月 13 日至今任汇添富鑫利债券基金的基金经理。2017 年 3 月 15 日至今任汇添富稳健添利定期开放债券基金的基金经理。2017 年 4 月 20 日至今任汇添富鑫汇定开债券基金的基金经理。2017 年 6 月 23 日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理。2017 年 9 月 27 日至今任汇添富民丰回报混合基金的基金经理。2018 年 1 月 25 日至今任添富鑫永定开债、添富鑫盛定开债的基金经理。

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

上半年市场先涨后跌。沪深 300 指数下跌 12.90%,上证 50 指数下跌 13.30%,创业板指数亦下跌 8.33%。美国发起的贸易战反复发酵严重影响了国内投资者信心,同时国内去杠杆挤压金融系统隐患,导致市场雪上加霜。只有一些与经济增长相关性较低的细分行业表现较好,如医药医疗服务 / 旅游 / 品牌消费等。上半年本基金管理人继续坚持采用市场中性的基本面对冲策略, 组合的平均股票仓位逐步提高,对冲品种主要采用 IF 和 IH,并部分采用了 IC,对冲比例控制在 80-100%之间。虽然基差成本仍然较大,组合在市场大跌的环境仍然取得了较为稳定的阿尔法收益。

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 1.157 元;本报告期基金份额净值增长率为 6.54%,业绩比较基准收益率为 0.74%。

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,我们对中国经济增长的韧性仍然具有信心。阶段性可能会看到货币与财政政策上的适度积极微调以应对外部冲击, 但是大概率不会回到大水漫灌的老路上。推动经济脱虚向实,结构转型,实现创新驱动增长仍是中长期的方向。从投资角度来看,我们判断市场将继续维持结构性分化格局。大消费 / 医药医疗 / 互联网等领域具备强大竞争力和企业家精神的优秀公司仍将是投资者青睐的稀缺标的。此外,在下半年流动性环境有望改善的背景下,价值型公司的估值修复也值得期待。

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: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相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;同一类别内每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,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:汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金
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	7,058,710.55	3,743,171.72
结算备付金	5,936,501.77	3,679,376.78
存出保证金	21,306,952.81	21,411,035.99
交易性金融资产	234,520,291.98	273,794,826.79
其中:股票投资	144,826,130.38	152,064,229.39
基金投资	-	-
债券投资	89,694,161.60	121,730,597.40
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	-	15,979,618.06
应收利息	1,897,499.14	1,267,886.65
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	270,719,956.25	319,875,915.99
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	2,508,320.09	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	330,189.43	398,934.35
应付托管费	55,031.58	66,489.06
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	233,340.46	403,140.50
应交税费	18,558.74	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	293,396.69	390,000.00
负债合计	3,438,836.99	1,258,563.91
所有者权益:		
实收基金	231,046,361.12	293,313,235.23
未分配利润	36,234,758.14	25,304,116.85
所有者权益合计	267,281,119.26	318,617,352.08
负债和所有者权益总计	270,719,956.25	319,875,915.99

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.157 元,基金份额总额 231,046,361.12 份。

6.2 利润表

会计主体: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
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 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	22,678,116.56	11,587,235.24
1.利息收入	2,256,032.74	5,220,318.83
其中:存款利息收入	74,851.06	3,906,205.11
债券利息收入	2,156,497.23	490,867.25
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	24,684.45	823,246.47
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	31,094,712.46	-2,867,384.52
其中:股票投资收益	23,529,508.89	3,039,842.95
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,786,885.31	41,036.19
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	4,715,333.56	-6,853,744.48
股利收益	1,062,984.70	905,480.82
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-10,786,360.68	9,234,300.93
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	113,732.04	-
减:二、费用	4,052,601.79	3,136,373.08
1. 管理人报酬	2,171,357.25	2,179,270.70
2. 托管费	361,892.91	363,211.81
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,274,493.98	445,828.65
5. 利息支出	3,521.67	-
其中:卖出回购金融资产支出	3,521.67	-
6. 税金及附加	22,244.07	-
7. 其他费用	219,091.91	148,061.92
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	18,625,514.77	8,450,862.16

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: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
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)	293,313,235.23	25,304,116.85	318,617,352.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,625,514.77	18,625,514.77
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)	-62,266,874.11	-7,694,873.48	-69,961,747.59
其中:1.基金申购款	91,746,944.33	10,550,973.73	102,297,918.06
2.基金赎回款	-154,013,818.44	-18,245,847.21	-172,259,665.65
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)	231,046,361.12	36,234,758.14	267,281,119.26

项目	上年度可比期间 2017年 3 月 15 日(基金合同生效日)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)	493,313,864.49	-	493,313,864.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,450,862.16	8,450,862.16
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	493,313,864.49	8,450,862.16	501,764,726.65

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

汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 (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[2014]741 号文《关于核准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募集的批复》准予注册,以及中国证券监督管理委员会机构部函[2016]2980 号文《关于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延期募集备案的回函》准予延期募集, 由汇添富基金管理股份有限公司作为基金发起人于 2017 年 2 月 20 日至 2017 年 3 月 10 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_B11 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 3 月 15 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 493,191,557.82 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 122,306.67 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 493,313,864.49 元,折合 493,313,864.49 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票),股指期货、权证,债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等,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的相关规定)。本基金基于基金管理人对市场机会的判断,灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略,在严格的风险管理下,追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。本基金的业绩比较基准为:一年期定期存款税后利率。

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 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司("招商银行")	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		上年度可比期间 2017年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	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	110,344,917.27	13.74%	301,463,105.20	92.48%

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		上年度可比期间 2017年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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	76,785,930.78	36.61%	2,505,368.30	100.00%

6.