汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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:2019年8月29日

§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2019年8月27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2019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	添富沪港深优势定开
基金主代码	006205
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年9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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	217,758,457.39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,以基本面分析为立足点,在科学严格管理风险的前提下,精选优质个股,为基金份额持有人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股票市场中具有核心竞争优势和长期持续增长模式的上市公司。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*15%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*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,属于中等收益/风险特征的基金。 本基金将投资港股通标的股票,将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

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20楼 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(2019年1月1日–2019年6月30日)
本期已实现收益	9,461,175.92
本期利润	25,388,206.77
加权平均基金份额本期利润	0.1166
本期基金份额净值增长率	11.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0406
期末基金资产净值	238,449,299.15
期末基金份额净值	1.0950

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。

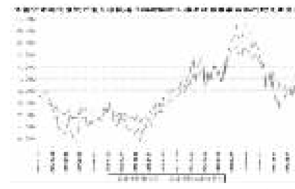
4、本基金的《基金合同》生效日为2018年9月21日,至本报告期末未满一年,因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2019年6月30日数据,特此说明。

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	7.45%	1.18%	4.93%	0.80%	2.52%	0.38%
过去三个月	2.36%	1.21%	0.53%	0.77%	1.83%	0.44%
过去六个月	11.92%	1.11%	11.47%	0.81%	0.45%	0.30%
自基金合同生效日起至今	9.50%	0.91%	6.60%	0.96%	2.90%	–0.05%

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》生效日为2018年9月21日;截止至本报告期末,基金成立未满1年;本基本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2018年09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。目前,公司注册资本金为132,724,224元人民币。公司总部设在上海,在北京、上海、广州、成都等地设有分公司,在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全,拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人及QFII基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来,始终将投资业绩放在首位,形成了独树一帜的品牌优势,被誉为“选股专家”,并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务,赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2019上半年,汇添富基金新成立13只公开募集证券投资基金,包括5只债券型基金、4只混合型基金、2只基金中基金、2只指数基金联接基金。截至2019年6月30日,公司共管理133只公开募集证券投资基金,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。

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		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、添富沪港深优势定开的基金经理	2018年9月21日	–	9	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,2018年9月21日至今任添富沪港深优势定开的基金经理。

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5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,去年影响港股市场的多个负面因素出现边际改善,但香港市场在一季度出现反弹后,在二季度出现下跌,总体市场波动加剧。一季度中,恒生指数在1月份出现了较大的涨幅,并在2–3月份维持震荡上行的走势。国际形势方面,中美贸易摩擦在一季度出现了进展,此外,美联储今年以来总体基调偏鸽派。国内方面,中央对于经济和金融系统稳定的重视程度仍然在持续上升,房地产和基建投资的边际改善为经济提供了支持。二季度中,港股市场出现回调,恒生指数在4月份创出了今年的新高,但5–6月份由于受到贸易摩擦恶化的影响,市场出现了较大的跌幅和波动。国际形势方面,中美贸易摩擦的担忧在5月重燃,美国不单对我国进口商品再次提高关税,并把华为放在实体清单,导致避险情绪上升。另一方面,美联储今年以来总体基调偏鸽派,市场的预期从去年底的加息预期已逐步调整为降息预期。国内方面,中央对于经济和金融系统稳定的重视程度仍然较高,二季度总体经济指标处于稳定区间。

本基金在去年9月份成立并处于建仓期,基于市场较为波动,短期影响市场的因素较多,本基金在去年四季度维持较低的仓位,直至今年初几个主要影响市场的负面因素出现边际改善,出于对未来宏观经济、行业和个股基本面变化的考虑,本基金在一季度择机提升仓位,在二季度保持着较为平稳的仓位,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具有长期竞争优势的龙头企业为主,在目前宏观经济的换挡期中,将有利于该行业中的龙头企业获得市场份额和长期盈利的提升,我们对于优质的中国企业的长期盈利前景较有信心,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,目前以目前以金融和消费为核心板块,并适当配置房地产、资讯科技、公用事业、工业等板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末添富沪港深优势定开基金份额净值为1.0950元,本报告期基金份额净值增长率为11.92%,同期业绩比较基准收益率为11.47%。

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、宏观经济数据、美联储货币政策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,按照目前情况来说,中国和美国的关系在长期来说仍有较大不确定性,两国贸易将进入新常态,未来的国际形势将更为复杂,但经过去年至今的经验来看,我们认为政府在“对冲政策”制定和企业在应对出口和生产的影响方面已经有一定程度的应变能力,及时灵活的财政和货币政策将有望对经济提供支持。此外,我们认为中央对于经济和金融系统稳定的重视程度仍然维持在高水平,并强调对民营经济的支持,我们可以期待在宽松货币政策和积极的财政政策支持下,效果将逐渐显现,宏观经济将有望逐步见底回升,结构升级转型将持续进行。海外流动性方面,美国进入降息周期,有利于资金回流新兴市场,并为国内货币政策留出空间。目前港股估值水平处于均值以下水平区域,我们依然相信市场依然存在结构性机会。

操作方面,我们认为不少行业将持续整合,利好优质龙头公司扩张市场份额,近期市场估值水平下移,为长期布局优质标的提供良好机会,我们将重点关注社融增速、信用市场流动性、房地产和汽车销售、出口情况、财政政策、美国降息步伐等等。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,本基金将持续以消费和金融为核心板块,并适当配置资讯科技、公用事业、工业、房地产等板块。我们将持续挖掘具有长期投资价值和竞争优势、估值合理的行业龙头企业进行投资。

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《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同,但具有不同特征的,若协会有特定调整估值方法的通知的,例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,应参照协会通知执行。

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。

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。

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

本报告期内,本基金托管人在对汇添富沪港深优势精选定期开放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,汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在对汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、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

本托管人依法对汇添富基金管理有限公司编制和披露的汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配、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:汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金
报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:		
银行存款	17,654,055.86	31,521,169.21
结算备付金	4,632,283.52	2,681,818.18
存出保证金	940,600.82	3,222,843.49
交易性金融资产	217,767,006.63	67,976,290.65
其中:股票投资	217,767,006.63	67,976,290.65
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	–	98,000,000.00
应收证券清算款	–	10,012,036.58
应收利息	3,616.34	112,396.01
应收股利	2,625,560.13	692.55
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	243,623,123.30	213,527,246.67
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	4,632,329.79	9.57
应付赎回款	–	–
应付管理人报酬	282,378.27	272,046.23
应付托管费	47,063.04	45,341.07
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	103,427.31	28,757.42
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	108,625.74	120,000.00
负债合计	5,173,824.15	466,154.29
所有者权益:		
实收基金	217,758,457.39	217,758,457.39
未分配利润	20,690,841.76	–4,697,365.01
所有者权益合计	238,449,299.15	213,061,092.38
负债和所有者权益总计	243,623,123.30	213,527,246.67

注: 报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0950元,基金份额总额217,758,457.39份。

6.2 利润表

会计主体:汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
一、收入	28,097,280.79
1.利息收入	380,778.65
其中:存款利息收入	112,245.18
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	268,533.47
其他利息收入	–
2.投资收益(损失以“–”填列)	11,789,471.29
其中:股票投资收益	8,616,176.44
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	3,173,294.85
3.公允价值变动收益(损失以“–”号填列)	15,927,030.85
4.汇兑收益(损失以“–”号填列)	–
5.其他收入(损失以“–”号填列)	–
减:二、费用	2,709,074.02
1. 管理人报酬	1,692,724.11
2. 托管费	282,120.71
3. 销售服务费	–
4. 交易费用	645,526.46
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	88,702.74
三、利润总额(亏损总额以“–”号填列)	25,388,206.77

注:本基金合同于2018年9月21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:汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	217,758,457.39	–4,697,365.01	213,061,092.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	25,388,206.77	25,388,206.77
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)	–	–	–
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)	217,758,457.39	20,690,841.76	238,449,299.15

注:本基金合同于2018年9月21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)变动表只列示本期数据,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

汇添富沪港深优势精选定期开放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]3084号文《关于准予汇添富年年瑞定期开放混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,并经中国证监会许可[2018]376号文《关于准予汇添富年年瑞定期开放混合型证券投资基金变更注册的批复》准予变更注册为汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金,由汇添富基金管理股份有限公司于2018年9月3日起至2018年9月19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60466941_B35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9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217,720,868.08元,在募集期间产生的利息为人民币37,589.31元,以上实收基金(本息)合计为人民币217,758,457.39元,折合217,758,457.39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或票据)、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。

本基金采用自下而上的投资方法,以基本面分析为立足点,在科学严格管理风险的前提下,精选优质个股,为基金份额持有人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2019年6月30日的财务状况以及2019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[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,本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在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,已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011年修订)》、《征收教育费附加的暂行规定(2011年修订)》及相关地方教育附加的征收规定,凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人,都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。

6.4.6.4 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。

6.4.6.5 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。

6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题,根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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、基金销售机构、基金注册登记机构
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	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:以上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 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票
东方证券股份有限公司	316,271,405.31	100.00

6.4.8.1.2 债券交易

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

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 2019年1月1日至2019年6月30日	
	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	560,000,000.00	100.00

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期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 2019年1月1日至2019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	256,960.36	100.00	103,427.31	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 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,692,724.11
其中:支付销售机构的客户维护费	226,727.89

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×1.50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致 的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	282,120.71

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.25%/当年天数
H为每日应支付的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致 的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

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:本基金本报告期末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均未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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
东方证券股份有限公司	5,988,833.95	2.75	5,988,833.95	2.75

注:东方证券股份有限公司于2018年9月14日运用6,000,000.00元认购本基金份额5,988,833.95份(含利息),认购费用11,976.05元,符合招募说明书规定的认购费率。

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 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	17,654,055.86	96,977.19

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:本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.9 期末(2019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

注:截至本报告期末2019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2019年6月30日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日,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	217,767,006.63	89.39
	其中:股票	217,767,006.63	89.39
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	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	22,286,339.38	9.15
8	其他各项资产	3,569,777.29	1.46
9	合计	243,623,123.30	100.00

注:本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币217,767,006.63元,占期末净值比例91.33%。

7.2 报告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

注:本基金本报告期末未持有境内股票投资。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
基础材料	12,712,142.59	5.33
消费者非必需品	46,049,413.71	19.31
消费者常用品	–	–
能源	–	–
金融	48,137,484.64	20.19
医疗保健	–	–
工业	36,541,604.19	15.32
信息技术	9,448,867.89	3.96
电信服务	16,438,910.15	6.89
公用事业	17,072,810.74	7.16
房地产	31,365,772.72	13.15
合计	217,767,006.63	91.31

注:(1)以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

(2)由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	53,000	16,438,910.15	6.89
2	00813	世茂房地产	766,500	16,047,373.48	6.73
3	01169	海尔电器	707,000	13,433,463.79	5.63
4	00586	海螺创业	553,000	13,426,074.65	5.63
5	01114	BRIL–LIANCECHI	1,608,000	12,221,221.94	5.13
6	06886	HTSC	946,000	11,184,208.36	4.69
7	02601	中国太保	388,600	10,443,086.01	4.38
8	01109	华润置地	338,000	10,227,982.75	4.29
9	00285	比亚迪电子	962,500	9,448,867.89	3.96
10	01313	华润水泥控股	1,400,000	9,322,636.68	3.91

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	01169	海尔电器	13,028,715.48	6.12
2	06886	HTSC	12,205,928.58	5.73
3	00813	世茂房地产	11,606,967.38	5.45
4	00285	比亚迪电子	10,179,952.21	4.78
5	02601	中国太保	9,451,715.12	4.44
6	00586	海螺创业	9,324,803.63	4.38
7	01313	华润水泥控股	9,116,306.47	4.28
8	01109	华润置地	9,060,873.93	4.25
9	00388	香港交易所	8,962,876.81	4.21
10	00552	中国通信服务	8,896,554.15	4.18
11	00881	中升控股	8,732,884.06	4.10
12	01114	BRILLIANCE CHI	8,676,311.18	4.07
13	000651	格力电器	8,509,018.17	3.99
14	03968	招商银行	8,270,169.92	3.88
15	01186	中国铁建	7,876,646.29	3.70
16	02238	广汽集团	7,194,681.01	3.38
17	02628	中国人寿	6,349,718.12	2.98
18	00700	腾讯控股	6,337,245.98	2.97
19	02318	中国平安	6,175,165.59	2.90
20	00958	华能新能源	5,742,643.67	2.70
21	01928	金沙中国有限公司	5,686,338.27	2.67
22	03993	洛阳钼业	4,960,403.83	2.33
23	01233	时代中国控股	4,519,746.20	2.12
24	03606	福耀玻璃	4,393,926.45	2.06
25	00371	北控水务集团	4,302,043.13	2.02
26	00027	银河娱乐	4,268,025.03	2.00

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	000651	格力电器	12,004,213.00	5.63
2	03883	中国奥园	8,800,926.79	4.13
3	00388	香港交易所	8,763,868.21	4.11
4	03968	招商银行	8,561,297.74	4.02
5	01928	金沙中国有限公司	6,350,849.71	2.98
6	01299	友邦保险	4,723,119.09	2.22
7	00857	中国石油股份	4,424,028.81	2.08
8	00027	银河娱乐	4,418,382.53	2.07
9	00817	中国金茂	4,117,995.41	1.93
10	00939	建设银行	4,111,471.81	1.93
11	600104	上汽集团	3,890,093.00	1.83
12	600585	海螺水泥	3,814,777.00	1.79
13	06869	长飞光纤光缆	3,776,283.14	1.77
14	01530	三生制药	3,578,748.06	1.68
15	00881	中升控股	3,324,828.94	1.56
16	01288	农业银行	3,127,772.94	1.47
17	00285	比亚迪电子	2,143,868.21	1.01
18	01114	BRILLIANCE CHI	2,053,685.02	0.96
19	00175	吉利汽车	1,859,701.73	0.87
20	00700	腾讯控股	1,761,302.79	0.83

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	220,854,722.62
卖出股票收入(成交)总额	95,607,213.93

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

注:本基金本报告期末未持有债券投资组合。

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

注:本基金本报告期末未持有债券投资组合。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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:本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查,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	940,600.82
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	2,625,560.13
4	应收利息	3,616.34
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,569,777.29

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

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		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
2,994	72,731.62	108,860,074.02	49.99	108,898,383.37	50.01

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	251,975.88	0.12

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情况

项目	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2018年9月21日)基金份额总额	217,758,457.39
本报告期期初基金份额总额	217,758,457.39
本报告期基金总申购份额	–
减:本报告期基金总赎回份额	–
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	217,758,457.39

注:总申购份额含红利再投份额。

§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

本报告期内,本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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,未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。

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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	3	316,271,405.31	100.00%	256,960.36	100.00%	–
海通证券	1	–	–	–	–	–
申万宏源证券	2	–	–	–	–	–
平安证券	1	–	–	–	–	–
中信建投	1	–	–	–	–	–
光大证券	2	–	–	–	–	–
国泰君安	2	–	–	–	–	–
招商证券	2	–	–	–	–	–
兴业证券	2	–	–	–	–	–
中信证券	2	–	–	–	–	–
中金公司	2	–	–	–	–	–
德邦证券	1	–	–	–	–	–
安信证券	2	–	–	–	–	–
瑞银证券	1	–	–	–	–	–
长江证券	1	–	–	–	–	–
北京高华	1	–	–	–	–	–
渤海证券	1	–	–	–	–	–
国元证券	1	–	–	–	–	–
西部证券	1	–	–	–	–	–
新时代证券	1	–	–	–	–	–
上海证券	1	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–
信达证券	1	–	–	–	–	–
第一创业	1	–	–	–	–	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
国联证券	1	–	–	–	–	–
广州证券	2	–	–	–	–	–
方正证券	2	–	–	–	–	–
银河证券	2	–	–	–	–	–
东北证券	2	–	–	–	–	–
西南证券	2	–	–	–	–	–
西藏东方财富	2	–	–	–	–	–
中泰证券	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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	–	–	560,000,000.00	100.00%	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
申万宏源证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
德邦证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
瑞银证券	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
北京高华	–	–	–	–	–	–
渤海证券	–	–	–	–	–	–
国元证券	–	–	–	–	–	–
西部证券	–	–	–	–	–	–
新时代证券	–	–	–	–	–	–
上海证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
信达证券	–	–	–	–	–	–
第一创业	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–
国联证券	–	–	–	–	–	–
广州证券	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–
东北证券	–	–	–	–	–	–
西南证券	–	–	–	–	–	–
西藏东方财富	–	–	–	–	–	–
中泰证券	–	–	–	–	–	–

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1)基金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:

本基金本报告期内退租4家证券公司的5个交易单元:首创证券(上交所单元)、申万宏源证券(上交所单元)、方正证券(深交所单元)、国金证券(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
2019年8月29日