汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF） 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:中信建投证券股份有限公司
送出日期:2019年8月29日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人中信建投证券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

基金名称	汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）
基金简称	汇添富中证全指证券公司指数（LOF）
基金主代码	501047
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2017年12月4日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	403,869,000.09份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018年1月18日

下属分级基金的基金简称	汇添富中证全指证券公司指数（LOF）A	汇添富中证全指证券公司指数（LOF）C
下属分级基金的场内简称	全指证券	证券C
下属分级基金的交易代码	501047	501048
报告期末下属分级基金的份额总额	131,063,853.53份	272,805,146.56份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，基金份额净值收益率与业绩比较基准收益率的跟踪误差。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率×95%＋银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	朱志明
	联系电话	021-28932888	4008-888-108
	电子邮箱	service@99fund.com	service@csc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95587
传真		021-28932998	010-85130975
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址		上海市富城路99号震旦国际大楼20楼	北京市东城区朝内大街2号凯恒中心B座10层
邮政编码		200120	100010
法定代表人		李文	王常青

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§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)	
	汇添富中证全指证券公司指数（LOF）A	汇添富中证全指证券公司指数（LOF）C
本期已实现收益	887,273.67	2,512,586.16
本期利润	18,568,613.47	4,342,564.79
加权平均基金份额本期利润	0.1676	0.0232
本期加权平均净值利润率	17.66%	2.38%
本期基金份额净值增长率	37.08%	38.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	-922,700.62	-62,419.38
期末可供分配基金份额利润	-0.0070	-0.0002
期末基金资产净值	130,141,152.91	272,742,727.18
期末基金份额净值	0.9930	0.9998
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-0.70%	-0.02%

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。

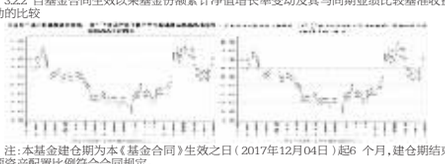
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

汇添富中证全指证券公司指数（LOF）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	9.72%	1.98%	9.60%	1.98%	0.12%	0.00%
过去三个月	-6.01%	2.24%	-6.65%	2.25%	0.64%	-0.01%
过去六个月	37.08%	2.56%	36.51%	2.64%	0.57%	-0.08%
过去一年	30.99%	2.26%	29.22%	2.31%	1.77%	-0.05%
自基金合同生效日起至今	-0.70%	2.01%	-5.31%	2.08%	4.61%	-0.07%
汇添富中证全指证券公司指数（LOF）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	9.81%	1.98%	9.60%	1.98%	0.21%	0.00%
过去三个月	-5.70%	2.24%	-6.65%	2.25%	0.95%	-0.01%
过去六个月	38.17%	2.56%	36.51%	2.64%	1.66%	-0.08%
过去一年	31.97%	2.26%	29.22%	2.31%	2.75%	-0.05%
自基金合同生效日起至今	-0.02%	2.01%	-5.31%	2.08%	5.29%	-0.07%

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12月04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		
董瑾	上海国企ETF联接、上证上海改革发展主题ETF、汇添富沪深300指数（LOF）、汇添富中证全指证券公司指数（LOF）的基金经理助理。	2017年12月18日	-	10	国籍:中国。学历:北京大学西方经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2010年8月至2012年12月任国泰基金管理有限公司产品经理助理,2012年12月至2015年9月任汇添富基金管理股份有限公司产品经理,2015年9月至2016年10月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016年11月加入汇添富基金管理股份有限公司,2017年12月18日至今任上海国企ETF联接、上证上海改革发展主题ETF、汇添富沪深300指数（LOF）、汇添富中证全指证券公司指数（LOF）的基金经理助理。
楚天舒	中证上海国企ETF、上海国企ETF联接、汇添富沪深300指数（LOF）、上证上海改革发展主题ETF、汇添富中证全指证券公司指数（LOF）的基金经理、指数与量化投资部副总监。	2017年12月4日	-	19	国籍:中国。学历:南开大学经济学博士。从业经历:曾任职于深圳商业银行、华安证券、华富基金管理公司、深圳证券交易所、上海证券交易所、华宝兴业基金管理公司,2014年5月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任指数与量化投资部副总监。2016年8月8日至今任中证上海国企ETF的基金经理,2016年9月18日至今任上海国企ETF联接的基金经理,2017年9月6日至今任汇添富沪深300指数（LOF）的基金经理,2017年12月1日至今担任上证上海改革发展主题ETF的基金经理,2017年12月4日至今担任汇添富中证全指证券公司指数（LOF）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

2019年上半年,中美贸易摩擦有所反复。在6月底举行的G20大阪峰会上,中美元首会晤并取得了最新的阶段性进展:一是美方表示不再对中国出口产品加征新的关税;二是双方同意在平等和相互尊重的基础上重启经贸磋商。三是特朗普同意美国的公司继续向华为出售零件。

中美贸易摩擦的影响是长期的，对国内的经济增长和产业结构调整都将产生深远的影响。同时,从上半年的实体经济情况来看,房地产投资后续支撑减弱,制造业投资增速有所下滑,专项债对基建投资有所拉动,消费总体保持平稳。二季度经济指标有一定程度的回落,下半年经济下行压力仍较大。因此,今年在宏观调控方面政策仍可能重点实施逆周期调节,通过财政减税降费和货币政策保持流动性合理充裕等对经济形成一定的支撑。

资本市场方面,金融供给侧改革仍将出成将加大企业直接融资的比例。科创板的推出定位于符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业,有利于更好的发挥资本市场的资源配置功能。另外,资本市场扩大对外开放,也引入了海外长期资金投资A股。

市场经过二季度的调整以后,估值重新回到了偏低的状态。报告期末,沪深300指数的市盈率为12.44,处于历史较低水平,未来存在进一步估值修复的空间。

从证券公司板块来看,二季度市场出现了一定程度的调整。后续逆周期调节政策的延续、金融供给侧改革的推进、科创板的推出等都将对券商板块形成利好。当市场风险偏好有所修复时,券商的盈利基础和业绩将直接得到改善。结合较为充裕的流动性,估值仍然存在一定的提升空间。

报告期内,本基金遵循被动指数投资原则,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富中证全指证券公司指数（LOF）A基金份额净值为0.9930元,本报告期基金份额净值增长率为37.08%;截至本报告期末汇添富中证全指证券公司指数（LOF）C基金份额净值为0.9998元，本报告期基金份额净值增长率为38.17%；同期业绩比较基准收益率为36.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年国内经济增速下行压力仍然较大,政策将保持定力,仍会坚持逆周期调节,统筹做好"六稳"工作。总体经济形势或将趋于平稳,出现系统性风险的概率较小。

政策方面,强调继续实施好稳健的货币政策。要坚持实施积极的财政政策、减税降费、专项债、平滑地方隐性债务和盘活补短板的盘主抓手。对内改革和对外开放并举,以开放促改革。

7月20日,国务院金稳委办公室宣布了11条金融业进一步对外开放的政策措施,涉及债市、保险、理财、券商、基金、期货、信用评级等多个领域,在外资限制放开进程中意义重大,加速A股国际化进程,标志着我国金融对外开放进入了新的阶段。

2019年下半年市场大概率仍将以结构性行情为主。行业上,建议关注受益于政策支持的基建、5G等通信基础设施建设;以及受益于大规模减税降费的必需消费等。

《证券公司股权管理规定》的出台,将会加速券商板块的整合,龙头券商优势进一步凸显。预计上市券商的业绩分化将更为明显,强者恒强。未来券商在规范化的框架下实现业务的逐步转型和长期健康发展,业绩预期改善,市场表现可期。

作为被动投资的指数型基金,汇添富中证全指证券公司指数（LOF）将严格遵守基金合同,继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差,实现投资目标。

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。

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:本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的份额,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式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式,具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

本基金本报告期未进行利润分配。

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

在本报告期内,本基金托管人在托管汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）过程中,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和基金合同的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

在本报告期内,本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的资产净值计算、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。本报告期内,汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分,以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§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:汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）

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	21,864,768.46	5,233,774.02
结算备付金	355,809.05	282,456.34
存出保证金	462,699.19	38,565.10
交易性金融资产	376,840,663.21	95,128,083.77
其中:股票投资	376,840,663.21	95,128,083.77
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	10,733.80	2,914.94
应收股利	-	-
应收申购款	7,006,330.06	536,993.77
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	406,541,003.77	101,222,787.94
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	610.73	-
应付赎回款	2,981,927.23	225,501.24
应付管理人报酬	158,230.87	43,573.46
应付托管费	31,646.18	8,714.69
应付销售服务费	53,562.12	7,572.32
应付交易费用	318,413.45	49,921.56
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	112,733.10	120,000.57
负债合计	3,657,123.68	455,283.84
所有者权益:		
实收基金	403,869,000.09	139,159,249.72
未分配利润	-985,120.00	-38,391,745.62
所有者权益合计	402,883,880.09	100,767,504.10
负债和所有者权益总计	406,541,003.77	101,222,787.94

注：报告截止日2019年6月30日,基金份额总额403,869,000.09份,其中汇添富中证全指证券公司指数（LOF）A基金份额总额为131,063,853.53份,基金份额净值0.9930元;汇添富中证全指证券公司指数（LOF）C基金份额总额为272,805,146.56份,基金份额净值0.9998元。

6.2 利润表

会计主体:汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）

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	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	24,924,578.07	-11,795,814.50
1.利息收入	162,605.16	368,846.13
其中:存款利息收入	162,577.66	280,235.03
债券利息收入	27.50	56.30
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	88,554.80
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	2,766,131.46	2,739,080.37
其中:股票投资收益	2,341,458.39	2,421,612.81
基金投资收益	-	-
债券投资收益	24,547.90	13,912.16
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	400,125.17	303,555.40
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	19,511,318.43	-14,993,316.30
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	2,484,523.02	89,575.30
减:二、费用	2,013,399.81	773,255.63
1、管理人报酬	703,318.22	254,507.83
2、托管费	140,663.64	50,901.55
3、销售服务费	222,682.15	56,253.35
4、交易费用	844,003.72	202,741.31
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	102,732.08	208,851.59
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	22,911,178.26	-12,569,070.13

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体:汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）

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）	139,159,249.72	-38,391,745.62	100,767,504.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,911,178.26	22,911,178.26
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）	264,709,750.37	14,495,447.36	279,205,197.73
其中:1.基金申购款	1,119,149,232.42	8,615,032.11	1,127,764,264.53
2.基金赎回款	-854,439,482.05	5,880,415.25	-848,559,066.80
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）	403,869,000.09	-985,120.00	402,883,880.09

项目	上年度可比期间 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）	255,339,481.80	-2,873,963.29	252,465,518.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,569,070.13	-12,569,070.13
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）	-160,983,495.96	-7,400,330.84	-168,383,826.80
其中:1.基金申购款	48,723,093.39	-4,728,402.49	43,994,690.90
2.基金赎回款	-209,706,589.35	-2,671,928.35	-212,378,517.70
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）	94,355,985.84	-22,843,364.26	71,512,621.58

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

汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）(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]1758号文《关于准予汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）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11月8日起至2017年11月28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_B44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12月4日正式生效。本基金为上市契约型开放式（LOF）,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255,196,695.99元,在募集期间产生的存款利息为人民币142,785.81元,以上实收基金（本息）合计为人民币255,339,481.80元,折合255,339,481.80份基金份额。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,基金还可投资于其他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、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、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、可转换债券（分离交易可转债）、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款）、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）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。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。本基金的业绩比较基准为:中证全指证券公司指数收益率×95%＋银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

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,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、基金销售机构、基金发起人
中信建投证券股份有限公司（"中信建投证券"）	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 2019年1月1日至2019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（%）
中信建投证券股份有限公司	642,411,533.93	100.00	127,792,713.75	100.00

6.4.8.1.2 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
中信建投证券股份有限公司	393,575.40	100.00	335,068.46	100.00

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		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
中信建投证券股份有限公司	-	-	60,000,000.00	100.00

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。