

# 汇添富恒生指数分级证券投资基金 2018 年 半年度报告

2018 年 06 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 25 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。

基金托管人中国农业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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录 .....</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示 .....                                | 2         |
| 1.2 目录 .....                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介 .....</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况 .....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明 .....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 .....                         | 6         |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 .....                      | 6         |
| 2.5 信息披露方式 .....                              | 6         |
| 2.6 其他相关资料 .....                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....</b>                | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告 .....</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 9         |
| 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 .....             | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....              | 13        |
| 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 13        |
| 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....             | 14        |
| 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 15        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 15        |
| 4.9 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 .....       | 16        |
| <b>§ 5 托管人报告 .....</b>                        | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 16        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... | 16        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....      | 16        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....</b>              | <b>17</b> |
| 6.1 资产负债表 .....                               | 17        |
| 6.2 利润表 .....                                 | 18        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                      | 19        |
| 6.4 报表附注 .....                                | 21        |
| <b>§ 7 投资组合报告 .....</b>                       | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 40        |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....              | 40        |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....                      | 41        |
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....       | 41        |
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....                     | 46        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....                | 47        |
| 7.7 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 .....    | 48        |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 48        |
| 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金融衍生品投资明细 ..... | 48        |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....   | 48        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 48        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>49</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 49        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 .....                      | 49        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 50        |
| 8.4 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的情况 .....     | 50        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>51</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>51</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 51        |
| 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 .....      | 51        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 53        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 53        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 54        |
| 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 .....         | 54        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 54        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 55        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>56</b> |
| 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 .....    | 56        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 56        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>57</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 57        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 57        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 57        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                |                |
|-----------------|------------------|----------------|----------------|
| 基金名称            | 汇添富恒生指数分级证券投资基金  |                |                |
| 基金简称            | 汇添富恒生指数分级(QDII)  |                |                |
| 场内简称            | 添富恒生             |                |                |
| 基金主代码           | 164705           |                |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                |                |
| 基金合同生效日         | 2014 年 3 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           | 中国农业银行股份有限公司     |                |                |
| 报告期末基金份额总额      | 403,264,362.08 份 |                |                |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                |                |
| 基金份额上市的证券交易所    | 深圳证券交易所          |                |                |
| 上市日期            | 2014 年 4 月 11 日  |                |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 恒生 A             | 恒生 B           | 添富恒生           |
| 下属分级基金的交易代码     | 150169           | 150170         | 164705         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 100,090,316.00   | 100,090,316.00 | 203,083,730.08 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。   |
| 投资策略   | 本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。   |
| 业绩比较基准 | 经人民币汇率调整的恒生指数收益率 $\times 95\%$ + 商业银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$   |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数及标的指数所表征的股票市场相似的风险收益特征，在股票基金中属于中等风险、中等收益的产品。本基金为境外证券投资的基金，主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。此外，从投资者具体持有的基金份额 |

|  |  |
|--|--|
|  | 来看,在分级运作期内,由于基金收益分配的安排,稳健收益类的恒生 A 份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额;积极收益类的恒生 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。 |
|--|--|

## 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                      | 中国农业银行股份有限公司                 |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李鹏                                 | 贺倩                           |
|             | 联系电话 | 021-28932888                       | 010-66060069                 |
|             | 电子邮箱 | service@99fund.com                 | tgxxpl@abchina.com           |
| 客户服务电话      |      | 400-888-9918                       | 95599                        |
| 传真          |      | 021-28932998                       | 010-68121816                 |
| 注册地址        |      | 上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座)6 楼 H686 室 | 北京市东城区建国门内大街 69 号            |
| 办公地址        |      | 上海市富城路 99 号震旦国际大厦 19-22 层          | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码        |      | 200120                             | 100031                       |
| 法定代表人       |      | 李文                                 | 周慕冰                          |

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目   |    | 境外资产托管人                                     |
|------|----|---|
| 名称   | 中文 | 香港上海汇丰银行有限公司                                |
|      | 英文 | The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd. |
| 注册地址 |    | 香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦                           |
| 办公地址 |    | 香港九龙深旺道一号,汇丰中心一座六楼                          |

注:本基金无境外投资顾问。

## 2.5 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》、《上海证券报》和《证券时报》                  |
| 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 19-22 楼 汇添富基金管理股份有限公司 |

## 2.6 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(2018年01月01日-2018年06月30日) |
|---------------|------------------------------|
| 本期已实现收益       | 39,123,970.38                |
| 本期利润          | -19,437,325.18               |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0446                      |
| 本期加权平均净值利润率   | -3.63%                       |
| 本期基金份额净值增长率   | -2.19%                       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年06月30日)            |
| 期末可供分配利润      | 104,913.89                   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0003                       |
| 期末基金资产净值      | 484,587,207.73               |
| 期末基金份额净值      | 1.202                        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2018年06月30日)            |
| 基金份额累计净值增长率   | 32.17%                       |

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，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    | 净值增长率① | 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 | -1.48% | 1.10%     | -1.88%     | 1.14%         | 0.40% | -0.04% |
| 过去三个月 | 1.95%  | 1.07%     | 1.20%      | 1.10%         | 0.75% | -0.03% |
| 过去六个月 | -2.19% | 1.15%     | -2.22%     | 1.17%         | 0.03% | -0.02% |
| 过去一年  | 9.45%  | 0.97%     | 8.78%      | 0.98%         | 0.67% | -0.01% |

|                     |        |       |        |       |        |        |
|---------------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三年                | 20.85% | 1.10% | 17.29% | 1.10% | 3.56%  | 0.00%  |
| 自基金合同<br>生效日起至<br>今 | 32.17% | 1.02% | 35.34% | 1.04% | -3.17% | -0.02% |

### 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

添富恒生累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2014年3月6日）起6个月，建仓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、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 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|---|-----------------|------|--------|--|
|     |   | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 赖中立 | 汇添富黄金及贵金属基金（LOF）的基金经理、汇添富恒生指数分级（QDII）基金、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富中证环境治理指数（LOF）基金、汇添富优选回报混合基金、汇添富中证港股通高股息投资指数（LOF）基金的基金经理。 | 2014年3月6日       |      | 10 年   | 国籍：中国，学历：北京大学中国经济研究中心金融学硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属基金（LOF）的基金经理，2014年3月6日至今任汇添富恒生指数分 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | <p>级 (QDII) 基金的基金经理，2015 年 1 月 6 日至今任汇添富 深 证 300ETF 基金、汇添富 深 证 300ETF 基金联接基金的基金经理，2015 年 5 月 26 日至 2016 年 7 月 13 日任汇添富香港优势混合基金的基金经理，2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证环境治理指数 (LOF) 基金的基金经理，2017 年 5 月 18 日至今任汇添富优选回报混合基金的基金经理，2017 年 11 月 24 日至今任汇添富中证港股通高股息投资指数 (LOF)</p> |
|--|--|--|--|--|--|

|  |  |  |  |  |              |
|--|--|--|--|--|--------------|
|  |  |  |  |  | 基金的基<br>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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

## 4.3 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。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 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。

### 4.4.2 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。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 18 年上半年，香港市场在宽幅横盘整理之后迎来一波调整，指数点位回到 17 年年底点位附近。我们认为，香港市场在经历了长达两年的持续上涨后，短期的调整是正常的现象，并不改变此前以机构投资者为主导的，围绕增量资金布局和价值发现的双轮驱动逻辑。按照我们对全球市场的统计分析，香港市场依然是全球范围内估值性价比最高的市场。随着两地互联互通机制不断完善，内地投资者配置港股已相当便利，机构大资金配置港股的力度逐渐增强，港股的投资生态逐渐转变，定价权已经随着资金增量配置而转移。而从价值发现的角度来看，恒生指数是香港市场最具代表性的股票指数，涵盖了最为优质的香港市场投资标的，且其中大量优质标的具有较高的分红率，对长期配置资金具有极高吸引力。从经济基本面角度来看，在十九大之后国内经济前景乐观，海外市场也处于经济复苏带来的乐观情绪推动当中，对香港市场影响较为正面，但在中美贸易战的风险因素作用下，市场波动可能会随之加剧。

报告期内，本基金按照基金合同，按照完全复制法进行恒生指数成份股指数化投资，严控基金跟踪误差，以期给投资者带来与恒生指数一致的收益。

### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金净值增长率-2.19%，业绩比较基准收益率-2.22%，超额收益为 0.03%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年下半年的港股市场，我们认为围绕香港上市的中国各大行业龙头将继续引领市场长期向好。从估值水平来看，香港市场在经历了 2017 年的上涨之后，估值有所抬升，恒生指数的估值水平已经恢复到过去 30 年的均值水平，但一些行业的龙头上市公司随着盈利水平的不断提升，估值水平依然保持在非常具有吸引力的水平。经济基本面来看，十九大召开明确了未来长期的发展和改革目标，改革路径的明确和逐步落地将给中国经济带来新的活力，中国经济转型的步伐在改革开放 40 周年之际将继续提速，新经济蓬勃发展将为市场带来超预期的盈利提升，而传统行业如大金融板块也将在未来迎来盈利提升。国外，中美贸易冲突的不确定性会给金融市场带来冲击，但我们认为该因素将是长期且缓慢体现的，不应在短期做过度反应。从资金面来看，香港

市场依然是全球权益类资产的估值洼地，资金流入香港市场的趋势短期内不会出现反转，并且随着香港市场与国内市场互联互通机制的不断完善，国内大型机构对港股的配置将成为标配，配置比例也会得到不断提升。

综上所述，我们对未来香港市场持较为乐观的态度，恒生指数作为香港市场的标杆指数，具备非常突出的配置价值。

#### 4.7 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验，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。

#### 4.8 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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。



## § 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：汇添富恒生指数分级证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2018年06月30日         | 上年度末<br>2017年12月31日         |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                            |                             |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 35,873,124.43              | 44,190,573.08               |
| 结算备付金           |            | 35,536.67                  | 8,067,077.77                |
| 存出保证金           |            | -                          | 101,059.80                  |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 450,999,172.98             | 526,906,761.50              |
| 其中：股票投资         |            | 450,999,172.98             | 526,906,761.50              |
| 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          | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                          | -                           |
| 应收证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 7,666.57                   | 9,485.20                    |
| 应收股利            |            | 1,916,175.65               | 79,434.34                   |
| 应收申购款           |            | 326,191.90                 | 1,902,582.49                |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 489,157,868.20             | 581,256,974.18              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2017年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                            |                             |
| 短期借款            |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                          | -                           |
| 应付证券清算款         |            | 95.91                      | 365,462.60                  |
| 应付赎回款           |            | 3,526,000.12               | 1,861,010.25                |
| 应付管理人报酬         |            | 451,457.46                 | 575,090.75                  |
| 应付托管费           |            | 94,053.60                  | 119,810.54                  |
| 应付销售服务费         |            | -                          | -                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 128,983.56                 | 44,435.31                   |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应交税费          |          | -              | -              |
| 应付利息          |          | -              | -              |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 370,069.82     | 484,109.14     |
| 负债合计          |          | 4,570,660.47   | 3,449,918.59   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 309,066,316.62 | 375,935,938.46 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 175,520,891.11 | 201,871,117.13 |
| 所有者权益合计       |          | 484,587,207.73 | 577,807,055.59 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 489,157,868.20 | 581,256,974.18 |

注：(1)报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.202 元，基金份额总额 403,264,362.08 份，其中下属添富恒生份额净值 1.202 元，份额总额 203,083,730.08 份；下属恒生 A 份额净值 1.022 元，份额总额 100,090,316.00 份；下属恒生 B 份额净值 1.382 元，份额总额 100,090,316.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 01 月 01 日 至 2018 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目               | 附注号      | 本期<br>2018 年 01 月 01 日 至<br>2018 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 01 月 01 日 至 2017<br>年 06 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>       |          | -14,233,414.21                               | 160,793,975.87                                    |
| 1. 利息收入           |          | 192,102.68                                   | 366,996.57  |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.11 | 192,102.68                                   | 366,996.57  |
| 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        |          | -  | -   |
| 其他利息收入            |          | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 44,429,696.53                                | 89,987,006.99                                     |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.12 | 38,657,090.82                                | 35,410,398.68                                     |
| 基金投资收益            | 6.4.7.13 | -  | -   |
| 债券投资收益            | 6.4.7.14 | -  | -   |
| 资产支持证券投资          | 6.4.7.15 | -  | -   |
| 收益                |          | -  | -   |
| 贵金属投资收益           | 6.4.7.16 | -  | -   |
| 衍生工具收益            | 6.4.7.17 | -  | 42,555,186.84                                     |

|                            |            |                       |                       |
|----------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|
| 股利收益                       | 6.4.7.18   | 5,772,605.71          | 12,021,421.47         |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.19   | -58,561,295.56        | 74,675,884.81         |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -949,791.37           | -5,452,650.74         |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.20   | 655,873.51            | 1,216,738.24          |
| <b>减：二、费用</b>              |            | <b>5,203,910.97</b>   | <b>9,651,085.28</b>   |
| 1.管理人报酬                    | 6.4.10.2.1 | 3,194,053.80          | 6,387,450.09          |
| 2.托管费                      | 6.4.10.2.2 | 665,427.82            | 1,330,718.73          |
| 3.销售服务费                    |            | -                     | -                     |
| 4.交易费用                     | 6.4.7.21   | 1,003,511.95          | 1,490,862.59          |
| 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                     | 6.4.7.22   | 340,917.40            | 442,053.87            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>-19,437,325.18</b> | <b>151,142,890.59</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富恒生指数分级证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2018年01月01日至2018年06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）                   | 375,935,938.46                | 201,871,117.13 | 577,807,055.59 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）         | -                             | -19,437,325.18 | -19,437,325.18 |
| 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） | -66,869,621.84                | -6,912,900.84  | -73,782,522.68 |
| 其中：1.基金申购款                        | 330,663,712.05                | 74,454,264.17  | 405,117,976.22 |

|  |                                    |                |                  |
|--|------------------------------------|----------------|------------------|
| 2. 基金赎回款                               | -397,533,333.89                    | -81,367,165.01 | -478,900,498.90  |
| 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)                        | 309,066,316.62                     | 175,520,891.11 | 484,587,207.73   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年06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)                        | 1,400,894,948.39                   | 59,960,430.66  | 1,460,855,379.05 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)              | -                                  | 151,142,890.59 | 151,142,890.59   |
| 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)      | -828,526,853.73                    | -47,835,527.97 | -876,362,381.70  |
| 其中:1. 基金申购款                            | 104,221,917.00                     | 8,656,755.92   | 112,878,672.92   |
| 2. 基金赎回款                               | -932,748,770.73                    | -56,492,283.89 | -989,241,054.62  |
| 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)                        | 572,368,094.66                     | 163,267,793.28 | 735,635,887.94   |

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

汇添富恒生指数分级证券投资基金(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[2013]1247号文《关于核准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人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2014年3月6日正式生效,首次设立募集规模为1,270,631,138.98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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司,境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司(The Hong Kong and Shanghai Banking Co.,Ltd.)。

本基金的份额包括汇添富恒生指数分级证券投资基金之基础份额(简称“添富恒生份额”)、汇添富恒生指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(简称“恒生A份额”)与汇添富恒生指数分级证券投资基金之积极收益类份额(简称“恒生B份额”)。其中,恒生A、恒生B的基金份额配比始终保持1:1的比率不变。本基金的基础份额为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。恒生A份额将具有低风险、收益稳定特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额,类似于债券型基金份额。恒生B份额则具有高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额,类似于具有收益杠杆性的股票型基金份额。

本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标,基金还可投资于债券、基金(包括股票基金、债券基金、交易所交易基金等)、金融衍生工具(包括远期合约、互换、期货、期权、权证等)、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的80%。本基金紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准:经人民币汇率调整的恒生指数收益率 $\times 95\%$ +商业银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

### 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 6 月 30 日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

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。

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.6.1 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 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2018年06月30日 |
|------|--------------------|
| 活期存款 | 35,873,124.43      |
| 定期存款 | —                  |

|                |               |
|----------------|---------------|
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -             |
| 存款期限 1-3 个月    | -             |
| 存款期限 3 个月以上    | -             |
| 其他存款           | -             |
| 合计：            | 35,873,124.43 |

注：本基金于 2018 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 9,416,900.38 元（折合人民币 7,939,388.71 元），美元 51.29 元（折合人民币 339.37 元）

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2018 年 06 月 30 日 |                |               |
|---------------|-------------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                      | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 428,190,117.20          | 450,999,172.98 | 22,809,055.78 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                       | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场                   | -              | -             |
|               | 银行间市场                   | -              | -             |
|               | 合计                      | -              | -             |
| 资产支持证券        | -                       | -              | -             |
| 基金            | -                       | -              | -             |
| 其他            | -                       | -              | -             |
| 合计            | 428,190,117.20          | 450,999,172.98 | 22,809,055.78 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2018 年 06 月 30 日 |
|----------|-------------------------|
| 应收活期存款利息 | 6,961.73                |
| 应收定期存款利息 | -                       |



|            |          |
|------------|----------|
| 应收其他存款利息   | -        |
| 应收结算备付金利息  | 704.84   |
| 应收债券利息     | -        |
| 应收资产支持证券利息 | -        |
| 应收买入返售证券利息 | -        |
| 应收申购款利息    | -        |
| 应收黄金合约拆借利息 | -        |
| 其他         | -        |
| 合计         | 7,666.57 |

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 128,983.56         |
| 银行间市场应付交易费用 | -                  |
| 合计          | 128,983.56         |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 11,948.67          |
| 应付指数使用费     | 44,890.48          |
| 应付审计费       | 34,712.18          |
| 应付信息披露费     | 248,765.71         |
| 应付上市费       | 29,752.78          |
| 合计          | 370,069.82         |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2018年01月01日至2018年06月30日 |                 |
|---------------|-------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                       | 账面金额            |
| 上年度末          | 461,795,058.39                | 375,935,938.46  |
| 本期申购          | 330,663,712.05                | 330,663,712.05  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -397,533,333.89               | -397,533,333.89 |
| -基金拆分/份额折算前   |                               | -               |
| 基金拆分/份额折算变    | 8,338,925.53                  | -               |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 动份额           |                |                |
| 本期申购          | -              | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -              | -              |
| 本期末           | 403,264,362.08 | 309,066,316.62 |

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计        |
|----------------|-----------------|-----------------|----------------|
| 上年度末           | -62,549,034.87  | 264,420,152.00  | 201,871,117.13 |
| 本期利润           | 39,123,970.38   | -58,561,295.56  | -19,437,325.18 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 23,529,978.38   | -30,442,879.22  | -6,912,900.84  |
| 其中：基金申购款       | -101,794,049.95 | 176,248,314.12  | 74,454,264.17  |
| 基金赎回款          | 125,324,028.33  | -206,691,193.34 | -81,367,165.01 |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -              |
| 本期末            | 104,913.89      | 175,415,977.22  | 175,520,891.11 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018年01月01日至2018年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 165,854.08                    |
| 定期存款利息收入  | -                             |
| 其他存款利息收入  | -                             |
| 结算备付金利息收入 | 21,973.68                     |
| 其他        | 4,274.92                      |
| 合计        | 192,102.68                    |

注：其他为直销申购款和交易保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2018年01月01日至2018年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 289,297,926.41                |
| 减：卖出股票成本总额 | 250,640,835.59                |
| 买卖股票差价收入   | 38,657,090.82                 |

#### 6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.16 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.17 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2018 年 01 月 01 日 至 2018 年 06 月 30 日 |
|-------------|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 5,772,605.71                              |
| 基金投资产生的股利收益 | -   |
| 合计          | 5,772,605.71                              |

#### 6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2018 年 01 月 01 日 至 2018 年 06 月 30 日 |
|------------------------|---|
| 1. 交易性金融资产             | -58,561,295.56                            |
| ——股票投资                 | -58,561,295.56                            |
| ——债券投资                 | -   |
| ——资产支持证券投资             | -   |
| ——基金投资                 | -   |
| ——贵金属投资                | -   |
| ——其他                   | -   |
| 2. 衍生工具                | -   |
| ——权证投资                 | -   |
| 3. 其他                  | -   |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -   |
| 合计                     | -58,561,295.56                            |

#### 6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2018 年 01 月 01 日 至 2018 年 06 月 30 日 |
|---------|---|
| 基金赎回费收入 | 655,873.51                                |
| 其他      | -   |
| 合计      | 655,873.51                                |

## 6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018年01月01日至2018年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 1,003,511.95                  |
| 银行间市场交易费用 | -                             |
| 合计        | 1,003,511.95                  |

## 6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2018年01月01日至2018年06月30日 |
|----------|-------------------------------|
| 审计费用     | 34,712.18                     |
| 信息披露费    | 148,765.71                    |
| 指数使用费    | 106,468.53                    |
| 港股通证券组合费 | 17,694.03                     |
| 银行汇划费用   | 3,524.17                      |
| 上市费      | 29,752.78                     |
| 合计       | 340,917.40                    |

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

## 6.4.9.1 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。

## 6.4.9.2 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、基金注册登记机构、基金销售 |
| 中国农业银行股份有限公司       | 基金托管人、基金代销机构        |
| 上海汇丰银行有限公司（“汇丰银行”） | 基金境外托管人             |
| 东方证券股份有限公司         | 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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2018年01月01日至2018年06月30日 |              | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年06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 | 408,699,505.87                | 78.21%       | 398,974,067.63                     | 47.91%       |

##### 6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 基金交易

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基金交易。

##### 6.4.10.1.5 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。

##### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2018年01月01日至2018年06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 | 376,452.90                         | 91.68         | 128,983.56 | 100.00          |
| 关联方名称      | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年06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 | 398,975.60                         | 75.40         | 96,514.15  | 100.00          |

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年01月01日至2018年06月30日 | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年<br>06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,194,053.80                  | 6,387,450.09                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 340,489.43                    | 354,642.08                             |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年01月01日至2018年06月30日 | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年<br>06月30日 |
|----------------|-------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 665,427.82                    | 1,330,718.73                           |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内基金管理人及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末和上年度末未投资本基金。

##### 6.4.10.5 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<br>2018年01月01日至2018年06<br>月30日 |            | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年06月30日 |            |
|--------------------|-----------------------------------|------------|------------------------------------|------------|
|                    | 期末余额                              | 当期利息收入     | 期末余额                               | 当期利息收入     |
| 中国农业银行股份有限公司       | 27,933,498.39                     | 165,400.93 | 121,280,071.59                     | 363,584.42 |
| 上海汇丰银行有限公司（“汇丰银行”） | 7,939,626.04                      | 453.15     | 7,760,940.16                       | 2,350.17   |

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国农业银行和境外资产托管人汇丰银行保管，按适用利率计息。

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注:截至本报告期末 2018 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证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注:截至本报告期末 2018 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证券款余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构,并明确了相应的风险管理职能。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。此外,基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%,其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃



而带来的变现困难。

6.4.13.3 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本报告期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款及部分应收申购款。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2018 年<br>06 月 30<br>日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1<br>年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------------------|--------|--------|-------------|-------|-------|-----|----|
| 资产                            |        |        |             |       |       |     |    |

|            |               |   |   |   |   |                 |                |
|------------|---------------|---|---|---|---|-----------------|----------------|
| 银行存款       | 35,873,124.43 | - | - | - | - | -               | 35,873,124.43  |
| 备付金        | 35,536.67     | - | - | - | - | -               | 35,536.67      |
| 存出保证金      | -             | - | - | - | - | -               | -              |
| 交易性金融资产    | -             | - | - | - | - | -450,999,172.98 | 450,999,172.98 |
| 应收股利       | -             | - | - | - | - | 1,916,175.65    | 1,916,175.65   |
| 应收利息       | -             | - | - | - | - | 7,666.57        | 7,666.57       |
| 应收申购款      | 8,718.01      | - | - | - | - | 317,473.89      | 326,191.90     |
| 衍生金融资产     | -             | - | - | - | - | -               | -              |
| 应收证券清算款    | -             | - | - | - | - | -               | -              |
| 应收买入返售金融资产 | -             | - | - | - | - | -               | -              |
| 其他资产       | -             | - | - | - | - | -               | -              |
| 资产总计       | 35,917,379.11 | - | - | - | - | -453,240,489.09 | 489,157,868.20 |
| 负债         |               |   |   |   |   |                 |                |
| 应付赎回款      | -             | - | - | - | - | 3,526,000.12    | 3,526,000.12   |
| 应付管理人报酬    | -             | - | - | - | - | 451,457.46      | 451,457.46     |
| 应付托管费      | -             | - | - | - | - | 94,053.60       | 94,053.60      |
| 应付证券清算款    | -             | - | - | - | - | 95.91           | 95.91          |
| 卖出回购金融资产款  | -             | - | - | - | - | -               | -              |
| 应付销售服务费    | -             | - | - | - | - | -               | -              |
| 应付交易费用     | -             | - | - | - | - | 128,983.56      | 128,983.56     |
| 应交税费       | -             | - | - | - | - | -               | -              |
| 应付利息       | -             | - | - | - | - | -               | -              |
| 应付利润       | -             | - | - | - | - | -               | -              |
| 其他负债       | -             | - | - | - | - | 370,069.82      | 370,069.82     |
| 负债总计       | -             | - | - | - | - | 4,570,660.47    | 4,570,660.47   |
| 利率敏感度缺     | 35,917,379.11 | - | - | - | - | -448,669,828.62 | 484,587,207.73 |

| 口                               |               |       |            |      |      |                |                |
|---------------------------------|---------------|-------|------------|------|------|----------------|----------------|
| 上年度<br>末<br>2017年<br>12月31<br>日 | 1个月以内         | 1-3个月 | 3个月-1<br>年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |
| 资产                              |               |       |            |      |      |                |                |
| 银行存款                            | 44,190,573.08 | -     | -          | -    | -    | -              | 44,190,573.08  |
| 备付金                             | 8,067,077.77  | -     | -          | -    | -    | -              | 8,067,077.77   |
| 存出保证<br>金                       | 101,059.80    | -     | -          | -    | -    | -              | 101,059.80     |
| 交易性金<br>融资产                     | -             | -     | -          | -    | -    | 526,906,761.50 | 526,906,761.50 |
| 应收股利                            | -             | -     | -          | -    | -    | 79,434.34      | 79,434.34      |
| 应收利息                            | -             | -     | -          | -    | -    | 9,485.20       | 9,485.20       |
| 应收申购<br>款                       | 20,445.46     | -     | -          | -    | -    | 1,882,137.03   | 1,902,582.49   |
| 衍生金融<br>资产                      | -             | -     | -          | -    | -    | -              | -              |
| 应收证券<br>清算款                     | -             | -     | -          | -    | -    | -              | -              |
| 其他资产                            | -             | -     | -          | -    | -    | -              | -              |
| 资产总<br>计                        | 52,379,156.11 | -     | -          | -    | -    | 528,877,818.07 | 581,256,974.18 |
| 负债                              |               |       |            |      |      |                |                |
| 应付赎回<br>款                       | -             | -     | -          | -    | -    | 1,861,010.25   | 1,861,010.25   |
| 应付管理<br>人报酬                     | -             | -     | -          | -    | -    | 575,090.75     | 575,090.75     |
| 应付托管<br>费                       | -             | -     | -          | -    | -    | 119,810.54     | 119,810.54     |
| 应付证券<br>清算款                     | -             | -     | -          | -    | -    | 365,462.60     | 365,462.60     |
| 卖出回购<br>金融资产<br>款               | -             | -     | -          | -    | -    | -              | -              |
| 应付销售<br>服务费                     | -             | -     | -          | -    | -    | -              | -              |
| 应付交易<br>费用                      | -             | -     | -          | -    | -    | 44,435.31      | 44,435.31      |
| 应交税费                            | -             | -     | -          | -    | -    | -              | -              |
| 应付利息                            | -             | -     | -          | -    | -    | -              | -              |
| 应付利润                            | -             | -     | -          | -    | -    | -              | -              |
| 其他负债                            | -             | -     | -          | -    | -    | 484,109.14     | 484,109.14     |

|         |               |   |   |   |   |                 |                |
|---------|---------------|---|---|---|---|-----------------|----------------|
| 负债总计    | -             | - | - | - | - | 3,449,918.59    | 3,449,918.59   |
| 利率敏感度缺口 | 52,379,156.11 | - | - | - | - | -525,427,899.48 | 577,807,055.59 |

注：上表统计了本基金资产及负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末及上年度末计息资产仅包括银行存款及部份应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2018年06月30日 |                |                |                |
|----------|--------------------|----------------|----------------|----------------|
|          | 美元<br>折合人民币元       | 港币<br>折合人民币元   | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计             |
| 以外币计价的资产 |                    |                |                |                |
| 银行存款     | 339.37             | 7,939,388.71   | -              | 7,939,728.08   |
| 存出保证金    | -                  | -              | -              | -              |
| 交易性金融资产  | -                  | 450,999,172.98 | -              | 450,999,172.98 |
| 应收股利     | -                  | 1,916,175.65   | -              | 1,916,175.65   |
| 应收利息     | -                  | -              | -              | -              |
| 应收申购款    | -                  | -              | -              | -              |
| 应收证券清算款  | -                  | -              | -              | -              |

|               |                          |                |                |                |
|---------------|--------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 其它资产          | -                        | 35,536.67      | -              | 35,536.67      |
| 资产合计          | 339.37                   | 460,890,274.01 | -              | 460,890,613.38 |
| 以外币计价的负债      |                          |                |                |                |
| 应付证券清算款       | -                        | -              | -              | -              |
| 应付赎回款         | -                        | -              | -              | -              |
| 应付管理人报酬       | -                        | -              | -              | -              |
| 应付托管费         | -                        | -              | -              | -              |
| 应付销售服务费       | -                        | -              | -              | -              |
| 应付交易费用        | -                        | -              | -              | -              |
| 应付赎回费         | -                        | -              | -              | -              |
| 负债合计          | -                        | -              | -              | -              |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 339.37                   | 460,890,274.01 | -              | 460,890,613.38 |
| 项目            | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |                |                |                |
|               | 美元<br>折合人民币元             | 港币<br>折合人民币元   | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计             |
| 以外币计价的资产      |                          |                |                |                |
| 银行存款          | 334.68                   | 8,828,577.46   | -              | 8,828,912.14   |
| 存出保证金         | -                        | -              | -              | -              |
| 交易性金融资产       | -                        | 526,906,761.50 | -              | 526,906,761.50 |
| 应收股利          | -                        | 79,434.34      | -              | 79,434.34      |
| 应收利息          | -                        | 5.80           | -              | 5.80           |
| 应收申购款         | -                        | -              | -              | -              |
| 应收证券清算款       | -                        | -              | -              | -              |

|               |        |                |   |                |
|---------------|--------|----------------|---|----------------|
| 其它资产          | -      | 8,067,077.77   | - | 8,067,077.77   |
| 资产合计          | 334.68 | 543,881,856.87 | - | 543,882,191.55 |
| 以外币计价的负债      |        |                |   |                |
| 应付证券清算款       | -      | 365,377.57     | - | 365,377.57     |
| 应付赎回款         | -      | -              | - | -              |
| 应付管理人报酬       | -      | -              | - | -              |
| 应付托管费         | -      | -              | - | -              |
| 应付销售服务费       | -      | -              | - | -              |
| 应付交易费用        | -      | -              | - | -              |
| 应付赎回费         | -      | -              | - | -              |
| 负债合计          | -      | 365,377.57     | - | 365,377.57     |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 334.68 | 543,516,479.30 | - | 543,516,813.98 |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

|    |   |                                 |                   |
|----|---|---------------------------------|-------------------|
| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变,且未考虑管理人人为降低汇率风险而可能采取的<br>风险管理活动。 |                                 |                   |
|    | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额(单位:人民币元) |                   |
|    |   | 本期末(2018年06月30日)                | 上年度末(2017年12月31日) |
| 分析 | 港币相对人民币升值5%                                       | 22,955,248.17                   | 27,171,852.25     |
|    | 港币相对人民币贬值5%                                       | -22,955,248.17                  | -27,171,852.25    |
|    | 美元相对人民币升值5%                                       | 16.97                           | 16.73             |
|    | 美元相对人民币贬值5%                                       | -16.97                          | -16.73            |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险,市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值

或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。另外还可投资于债券、基金、金融衍生工具、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，所面临的最大的市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2018年06月30日 |                  | 上年度末<br>2017年12月31日 |                  |
|---------------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值               | 占基金资产净值<br>比例(%) | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 450,999,172.98     | 93.07            | 526,906,761.50      | 91.19            |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                  | —                | —                   | —                |
| 交易性金融资产—债券投资  | —                  | —                | —                   | —                |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | —                  | —                | —                   | —                |
| 衍生金融资产—权证投资   | —                  | —                | —                   | —                |
| 其他            | —                  | —                | —                   | —                |
| 合计            | 450,999,172.98     | 93.07            | 526,906,761.50      | 91.19            |

注：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的80%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |   |                             |                   |
|----|---|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 1、本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合的贝塔系数紧密相关；<br>2、以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。 |                             |                   |
|    | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |   | 本期末（2018年06月30日）            | 上年度末（2017年12月31日） |
| 分析 | 经人民币汇率调整的恒生指数收益率增加5%  | 21,611,357.19               | 26,219,402.84     |

|  |                           |                |                |
|--|---------------------------|----------------|----------------|
|  | 经人民币汇率调整的恒生<br>指数收益率减少 5% | -21,611,357.19 | -26,219,402.84 |
|--|---------------------------|----------------|----------------|

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，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              | 450,999,172.98 | 92.20         |
|    | 其中：普通股            | 450,999,172.98 | 92.20         |
|    | 存托凭证              | -              | -             |
|    | 优先股               | -              | -             |
|    | 房地产信托凭证           | -              | -             |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -              | -             |
|    | 其中：债券             | -              | -             |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
|    | 其中：远期             | -              | -             |
|    | 期货                | -              | -             |
|    | 期权                | -              | -             |
|    | 权证                | -              | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 6  | 货币市场工具            | -              | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 35,908,661.10  | 7.34          |
| 8  | 其他各项资产            | 2,250,034.12   | 0.46          |
| 9  | 合计                | 489,157,868.20 | 100.00        |

注：1、本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 443,448,158.60 人民币，占期末净值比例 91.51%。

2、由于四舍五入的原因市值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|--------|----------------|---------------|
| 香港     | 450,999,172.98 | 93.07         |



|    |                |       |
|----|----------------|-------|
| 合计 | 450,999,172.98 | 93.07 |
|----|----------------|-------|

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别      | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|-----------|----------------|--------------|
| 10 能源     | 29,891,292.69  | 6.17         |
| 15 原材料    | -              | -            |
| 20 工业     | 18,395,266.38  | 3.80         |
| 25 非必需消费品 | 17,418,117.20  | 3.59         |
| 30 必需消费品  | 11,150,368.47  | 2.30         |
| 35 医疗保健   | 5,434,959.84   | 1.12         |
| 40 金融     | 215,483,814.68 | 44.47        |
| 45 信息技术   | 55,615,943.04  | 11.48        |
| 50 电信服务   | 24,647,269.71  | 5.09         |
| 55 公用事业   | 21,570,946.40  | 4.45         |
| 60 房地产    | 51,391,194.57  | 10.61        |
| 合计        | 450,999,172.98 | 93.07        |

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。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)                 | 公司名称(中文)     | 证券代码    | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股)        | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------------------|--------------|---------|--------|----------|--------------|---------------|--------------|
| 1  | TENCENT HOLDINGS LTD     | 腾讯控股有限公司     | 700 HK  | 香港交易所  | 香港       | 140,200.00   | 46,548,191.76 | 9.61         |
| 2  | HSBC HOLDINGS PLC        | 汇丰控股有限公司     | 5 HK    | 香港交易所  | 香港       | 742,800.00   | 46,092,344.45 | 9.51         |
| 3  | AIA GROUP LTD            | 友邦保险控股有限公司   | 1299 HK | 香港交易所  | 香港       | 702,000.00   | 40,601,335.32 | 8.38         |
| 4  | CHINA CONSTRUCTION BANK  | 中国建设银行股份有限公司 | 939 HK  | 香港交易所  | 香港       | 5,592,000.00 | 34,180,960.20 | 7.05         |
| 5  | IND & COMM BANK OF CHINA | 中国工商银行股份有限公司 | 1398 HK | 香港交易所  | 香港       | 4,290,000.00 | 21,231,197.13 | 4.38         |

|    |                                | 公司               |         | 交易所     |    |              |               |      |
|----|--------------------------------|------------------|---------|---------|----|--------------|---------------|------|
| 6  | CHINA MOBILE LTD               | 中国移动有限公司         | 941 HK  | 香港联合交易所 | 香港 | 357,000.00   | 20,978,772.99 | 4.33 |
| 7  | PING AN INSURANCE GROUP        | 中国平安保险(集团)股份有限公司 | 2318 HK | 香港联合交易所 | 香港 | 303,000.00   | 18,444,161.46 | 3.81 |
| 8  | BANK OF CHINA LTD              | 中国银行股份有限公司       | 3988 HK | 香港联合交易所 | 香港 | 4,619,000.00 | 15,148,744.92 | 3.13 |
| 9  | HONG KONG EXCHANGES            | 香港交易及结算有限公司      | 388 HK  | 香港联合交易所 | 香港 | 68,500.00    | 13,629,554.60 | 2.81 |
| 10 | CNOOC LTD                      | 中国海洋石油有限公司       | 883 HK  | 香港联合交易所 | 香港 | 1,038,000.00 | 11,849,365.81 | 2.45 |
| 11 | CK Hutchison Holdings Limited  | 长江和记实业有限公司       | 1 HK    | 香港联合交易所 | 香港 | 157,108.00   | 11,020,485.20 | 2.27 |
| 12 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CO. | 中国石油化工股份有限公司     | 386 HK  | 香港联合交易所 | 香港 | 1,484,000.00 | 8,770,634.40  | 1.81 |
| 13 | CK ASSET HOLDINGS              | 长江实业集团有限公司       | 1113 HK | 香港联合交易所 | 香港 | 150,608.00   | 7,910,704.78  | 1.63 |
| 14 | CLP HOLDINGS LTD               | 中电控股有限公司         | 2 HK    | 香港联合交易所 | 香港 | 110,000.00   | 7,836,614.50  | 1.62 |
| 15 | SUN HUNG KAI PROPERT           | 新鸿基地产发展有限公司      | 16 HK   | 香港联合交易所 | 香港 | 76,000.00    | 7,586,551.04  | 1.57 |
| 16 | LINK REIT                      | 领展房地产投资信托基金      | 823 HK  | 香港联合交易所 | 香港 | 125,000.00   | 7,551,014.38  | 1.56 |

|    |                                   |                |         |         |    |              |              |      |
|----|-----------------------------------|----------------|---------|---------|----|--------------|--------------|------|
|    |                                   |                |         | 所       |    |              |              |      |
| 17 | CHINA LIFE INSURANCE              | 中国人寿保险股份有限公司   | 2628 HK | 香港联合交易所 | 香港 | 433,000.00   | 7,392,511.58 | 1.53 |
| 18 | HANG SENG BANK LTD                | 恒生银行有限公司       | 11 HK   | 香港联合交易所 | 香港 | 44,500.00    | 7,361,021.79 | 1.52 |
| 19 | GALAXY ENTERTAINMENT              | 银河娱乐集团有限公司     | 27 HK   | 香港联合交易所 | 香港 | 138,000.00   | 7,068,128.85 | 1.46 |
| 20 | HONG KONG & CHINA GAS CO. LTD     | 香港中华煤气有限公司     | 3 HK    | 香港联合交易所 | 香港 | 536,562.00   | 6,794,678.84 | 1.40 |
| 21 | BOC HONG KONG HOLDINGS            | 中银香港(控股)有限公司   | 2388 HK | 香港联合交易所 | 香港 | 215,000.00   | 6,697,797.18 | 1.38 |
| 22 | PETROCHINA CO. LTD                | 中国石油天然气股份有限公司  | 857 HK  | 香港联合交易所 | 香港 | 1,226,000.00 | 6,170,834.38 | 1.27 |
| 23 | CHINA PHARMACEUTICAL              | 石药集团有限公司       | 1093 HK | 香港联合交易所 | 香港 | 272,000.00   | 5,434,959.84 | 1.12 |
| 24 | Geely Automobile Holdings Limited | 吉利汽车控股有限公司     | 175 HK  | 香港联合交易所 | 香港 | 313,000.00   | 5,370,167.61 | 1.11 |
| 25 | COUNTRY GARDEN HOLDINGS           | 碧桂园控股有限公司      | 2007 HK | 香港联合交易所 | 香港 | 442,000.00   | 5,142,572.76 | 1.06 |
| 26 | SUNNY OPTICAL TECH                | 舜宇光学科技(集团)有限公司 | 2382 HK | 香港联合交易所 | 香港 | 41,500.00    | 5,108,342.90 | 1.05 |
| 27 | SANDS CHINA LTD                   | 金沙中国有限公司       | 1928 HK | 香港联合交易所 | 香港 | 140,800.00   | 4,979,820.74 | 1.03 |

|    |                                      |                    |         |       |    |            |              |      |
|----|--------------------------------------|--------------------|---------|-------|----|------------|--------------|------|
| 28 | CHINA OVERSEAS LAND                  | 中国海外发展有限公司         | 688 HK  | 香港交易所 | 香港 | 222,000.00 | 4,838,297.97 | 1.00 |
| 29 | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS            | 瑞声科技控股有限公司         | 2018 HK | 香港交易所 | 香港 | 42,500.00  | 3,959,408.38 | 0.82 |
| 30 | POWER ASSETS HOLDINGS                | 电能实业有限公司           | 6 HK    | 香港交易所 | 香港 | 80,500.00  | 3,722,644.82 | 0.77 |
| 31 | CHINA UNICOM HONG KONG               | 中国联合网络通信(香港)股份有限公司 | 762 HK  | 香港交易所 | 香港 | 444,000.00 | 3,668,496.72 | 0.76 |
| 32 | CHINA RESOURCE S LAND                | 华润置地有限公司           | 1109 HK | 香港交易所 | 香港 | 162,000.00 | 3,612,599.19 | 0.75 |
| 33 | CHINA MENGNIU DAIRY                  | 中国蒙牛乳业有限公司         | 2319 HK | 香港交易所 | 香港 | 160,000.00 | 3,588,233.60 | 0.74 |
| 34 | Wharf Real Estate Investment Co. Ltd | 九龙仓置业地产投资有限公司      | 1997 HK | 香港交易所 | 香港 | 71,000.00  | 3,343,186.59 | 0.69 |
| 35 | NEW WORLD DEVELOPMENT                | 新世界发展有限公司          | 17 HK   | 香港交易所 | 香港 | 352,000.00 | 3,276,354.05 | 0.68 |
| 36 | MTR CORPORATION LTD                  | 香港铁路有限公司           | 66 HK   | 香港交易所 | 香港 | 87,500.00  | 3,201,672.25 | 0.66 |
| 37 | CITIC Pacific Limited                | 中国中信股份有限公司         | 267 HK  | 香港交易所 | 香港 | 338,000.00 | 3,151,743.87 | 0.65 |
| 38 | CHINA SHENHUA ENERGY                 | 中国神华能源股份有限公司       | 1088 HK | 香港交易所 | 香港 | 197,500.00 | 3,100,458.10 | 0.64 |
| 39 | WH Group Limi                        | 万洲国际有              | 288 HK  | 香港    | 香港 | 512,00     | 2,758,353    | 0.57 |

|    |                                     |                |         |                        |    |                |                  |      |
|----|-------------------------------------|----------------|---------|------------------------|----|----------------|------------------|------|
|    | ted                                 | 限公司            |         | 联 合<br>交 易<br>所        |    | 0.00           | .41              |      |
| 40 | HENDERSON LAND<br>DEVELOPMENT       | 恒基兆业地<br>产有限公司 | 12 HK   | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 香港 | 76,628<br>.00  | 2,681,110<br>.27 | 0.55 |
| 41 | HENGAN INTL G<br>ROUP CO.           | 恒安国际集<br>团有限公司 | 1044 HK | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 香港 | 42,000<br>.00  | 2,673,470<br>.10 | 0.55 |
| 42 | BANK OF COMMU<br>NICATIONS          | 交通银行股<br>份有限公司 | 3328 HK | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 香港 | 509,00<br>0.00 | 2,579,118<br>.78 | 0.53 |
| 43 | WANT WANT CHI<br>NA HOLDINGS        | 中国旺旺控<br>股有限公司 | 151 HK  | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 香港 | 362,00<br>0.00 | 2,130,311<br>.36 | 0.44 |
| 44 | The Bank of<br>East AsiaLimit<br>ed | 东亚银行有<br>限公司   | 23 HK   | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 香港 | 80,400<br>.00  | 2,125,067<br>.27 | 0.44 |
| 45 | SWIRE PACIFIC<br>LTD                | 太古股份有<br>限公司   | 19 HK   | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 香港 | 29,000<br>.00  | 2,031,786<br>.69 | 0.42 |
| 46 | CHEUNG KONG I<br>NFRASTRUCTURE      | 长江基建集<br>团有限公司 | 1038 HK | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 香港 | 39,000<br>.00  | 1,912,024<br>.34 | 0.39 |
| 47 | Sino Land Com<br>pany Limited       | 信和置业有<br>限公司   | 83 HK   | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 香港 | 168,00<br>0.00 | 1,807,336<br>.61 | 0.37 |
| 48 | HANG LUNG PRO<br>PERTIES            | 恒隆地产有<br>限公司   | 101 HK  | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 香港 | 118,00<br>0.00 | 1,609,680<br>.24 | 0.33 |
| 49 | CHINA RESOURCE<br>S POWER           | 华润电力控<br>股有限公司 | 836 HK  | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 香港 | 112,00<br>0.00 | 1,304,983<br>.90 | 0.27 |
| 50 | CHINA MERCHANT<br>S HOLDINGS        | 招商局港口<br>控股有限公 | 144 HK  | 香 港<br>联 合             | 香港 | 76,000<br>.00  | 1,021,365<br>.06 | 0.21 |

|  |  |   |  |       |  |  |  |  |
|--|--|---|--|-------|--|--|--|--|
|  |  | 司 |  | 交 易 所 |  |  |  |  |
|--|--|---|--|-------|--|--|--|--|

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文)                       | 证券代码    | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------------------------------|---------|---------------|-----------------|
| 1  | TENCENT HOLDINGS LTD           | 700 HK  | 35,930,216.60 | 6.22            |
| 2  | HSBC HOLDINGS PLC              | 5 HK    | 26,453,443.07 | 4.58            |
| 3  | CHINA CONSTRUCTION BANK        | 939 HK  | 16,833,425.10 | 2.91            |
| 4  | AIA GROUP LTD                  | 1299 HK | 16,327,922.83 | 2.83            |
| 5  | IND & COMM BK OF CHINA         | 1398 HK | 9,937,251.42  | 1.72            |
| 6  | LINK REIT                      | 823 HK  | 9,260,334.52  | 1.60            |
| 7  | CHINA MOBILE LTD               | 941 HK  | 9,250,409.21  | 1.60            |
| 8  | PING AN INSURANCE GROUP        | 2318 HK | 8,665,575.01  | 1.50            |
| 9  | BANK OF CHINA LTD              | 3988 HK | 6,797,949.31  | 1.18            |
| 10 | HONG KONG EXCHANGES            | 388 HK  | 6,299,583.20  | 1.09            |
| 11 | CHINA PHARMACEUTICAL           | 1093 HK | 5,708,093.59  | 0.99            |
| 12 | CK Hutchison Holdings Limited  | 1 HK    | 5,233,871.66  | 0.91            |
| 13 | SUN HUNG KAI PROPERT           | 16 HK   | 4,738,575.66  | 0.82            |
| 14 | CNOOC LTD                      | 883 HK  | 4,427,315.81  | 0.77            |
| 15 | CK ASSET HOLDINGS              | 1113 HK | 3,572,376.68  | 0.62            |
| 16 | CHINA LIFE INSURANCE           | 2628 HK | 3,558,200.48  | 0.62            |
| 17 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CO. | 386 HK  | 3,491,111.93  | 0.60            |
| 18 | GALAXY ENTERTAINMENT           | 27 HK   | 3,051,940.94  | 0.53            |
| 19 | CLP HOLDINGS LTD               | 2 HK    | 2,998,152.56  | 0.52            |
| 20 | HANG SENG BANK LTD             | 11 HK   | 2,930,629.36  | 0.51            |

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文) | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|------|----------|-----------------|
|----|----------|------|----------|-----------------|

|    |                                |         |               |      |
|----|--------------------------------|---------|---------------|------|
| 1  | TENCENT HOLDINGS LTD           | 700 HK  | 37,712,324.04 | 6.53 |
| 2  | HSBC HOLDINGS PLC              | 5 HK    | 29,309,862.50 | 5.07 |
| 3  | CHINA CONSTRUCTION BANK        | 939 HK  | 27,212,543.65 | 4.71 |
| 4  | AIA GROUP LTD                  | 1299 HK | 21,570,784.36 | 3.73 |
| 5  | IND & COMM BK OF CHINA         | 1398 HK | 13,082,012.81 | 2.26 |
| 6  | CHINA MOBILE LTD               | 941 HK  | 11,708,836.29 | 2.03 |
| 7  | PING AN INSURANCE GROUP        | 2318 HK | 11,401,343.56 | 1.97 |
| 8  | LINK REIT                      | 823 HK  | 10,351,318.03 | 1.79 |
| 9  | BANK OF CHINA LTD              | 3988 HK | 8,858,029.12  | 1.53 |
| 10 | HONG KONG EXCHANGES            | 388 HK  | 8,095,051.52  | 1.40 |
| 11 | CK Hutchison Holdings Limited  | 1 HK    | 6,779,114.34  | 1.17 |
| 12 | SUN HUNG KAI PROPERT           | 16 HK   | 5,817,852.95  | 1.01 |
| 13 | CNOOC LTD                      | 883 HK  | 5,713,775.84  | 0.99 |
| 14 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CO. | 386 HK  | 4,690,175.18  | 0.81 |
| 15 | CK ASSET HOLDINGS              | 1113 HK | 4,567,297.71  | 0.79 |
| 16 | CHINA LIFE INSURANCE           | 2628 HK | 4,409,986.73  | 0.76 |
| 17 | GALAXY ENTERTAINMENT           | 27 HK   | 4,233,823.33  | 0.73 |
| 18 | CLP HOLDINGS LTD               | 2 HK    | 4,022,898.33  | 0.70 |
| 19 | BOC HONG KONG HOLDINGS         | 2388 HK | 3,841,322.06  | 0.66 |
| 20 | HANG SENG BANK LTD             | 11 HK   | 3,812,883.11  | 0.66 |

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

|            |                |
|------------|----------------|
| 买入成本（成交）总额 | 233,294,542.97 |
| 卖出收入（成交）总额 | 289,297,926.41 |

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 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。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门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。

#### 7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.11.3 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   | —            |
| 2  | 应收证券清算款 | —            |
| 3  | 应收股利    | 1,916,175.65 |
| 4  | 应收利息    | 7,666.57     |
| 5  | 应收申购款   | 326,191.90   |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 2,250,034.12 |

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 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

| 份额<br>级别 | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>例 (%) | 持有份额           | 占总份额比<br>例 (%) |
| 恒生<br>A  | 343              | 291,808.50    | 85,632,118.00  | 85.55          | 14,458,198.00  | 14.45          |
| 恒生<br>B  | 4,840            | 20,679.82     | 1,977,154.00   | 1.98           | 98,113,162.00  | 98.02          |
| 添富<br>恒生 | 22,591           | 8,989.59      | 46,259,073.40  | 22.78          | 156,824,656.68 | 77.22          |
| 合计       | 27,774           | 14,519.49     | 133,868,345.40 | 33.20          | 269,396,016.68 | 66.80          |

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

恒生 A

| 序号 | 持有人名称                       | 持有份额 (份)      | 占上市总份额比例 (%) |
|----|-----------------------------|---------------|--------------|
| 1  | 中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红     | 42,865,348.00 | 42.83        |
| 2  | 中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品   | 17,571,120.00 | 17.56        |
| 3  | 中国银河证券股份有限公司                | 13,226,580.00 | 13.21        |
| 4  | 广发基金-招商银行-招商财富资产管理有限公司      | 5,949,502.00  | 5.94         |
| 5  | 上海均直资产管理有限公司-均直孔最长强私募证券投资基金 | 2,255,245.00  | 2.25         |
| 6  | 金新颜                         | 1,131,291.00  | 1.13         |
| 7  | 陈媚                          | 971,500.00    | 0.97         |
| 8  | 中国国际金融股份有限公司                | 896,200.00    | 0.90         |
| 9  | 苏宁易购集团股份有限公司                | 804,300.00    | 0.80         |
| 10 | 深圳快快资产管理有限公司                | 720,427.00    | 0.72         |

恒生 B

| 序号 | 持有人名称           | 持有份额 (份)     | 占上市总份额比例 (%) |
|----|-----------------|--------------|--------------|
| 1  | 杨继耘             | 5,501,000.00 | 5.50         |
| 2  | 廖雪静             | 5,010,000.00 | 5.01         |
| 3  | 李燕欢             | 1,849,700.00 | 1.85         |
| 4  | 李晓岱             | 1,772,800.00 | 1.77         |
| 5  | 熊华              | 1,500,000.00 | 1.50         |
| 6  | 长江证券-招商银行-长江证券超 | 1,350,000.00 | 1.35         |

|    | 越理财基金管家 II 集合资产管 |              |      |
|----|------------------|--------------|------|
| 7  | 吴旋玲              | 1,230,000.00 | 1.23 |
| 8  | 郭峰               | 1,182,750.00 | 1.18 |
| 9  | 李治国              | 1,100,000.00 | 1.10 |
| 10 | 王鹏               | 999,900.00   | 1.00 |

## 添富恒生

| 序号 | 持有人名称                           | 持有份额（份）      | 占上市总份额比例（%） |
|----|---------------------------------|--------------|-------------|
| 1  | 长江证券-招商银行-长江证券超越理财基金管家 II 集合资产管 | 4,440,000.00 | 21.95       |
| 2  | 陈远亮                             | 1,636,918.00 | 8.09        |
| 3  | 中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红         | 1,556,287.00 | 7.69        |
| 4  | 周绍勋                             | 900,152.00   | 4.45        |
| 5  | 徐庆                              | 754,408.00   | 3.73        |
| 6  | 中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品       | 637,946.00   | 3.15        |
| 7  | 周蔓琳                             | 571,400.00   | 2.83        |
| 8  | 张卓君                             | 528,949.00   | 2.62        |
| 9  | 柴庆丰                             | 523,400.00   | 2.59        |
| 10 | 黄嵩俊                             | 349,901.00   | 1.73        |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别 | 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 | 恒生 A | -          | -           |
|                  | 恒生 B | -          | -           |
|                  | 添富恒生 | 119,344.96 | 0.06        |
|                  | 合计   | 119,344.96 | 0.03        |

## 8.4 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的情况

| 项目                             | 份额级别 | 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 | 恒生 A | 0                 |
|                                | 恒生 B | 0                 |
|                                | 添富恒生 | 0                 |
|                                | 合计   | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 恒生 A | 0                 |
|                                | 恒生 B | 0                 |
|                                | 添富恒生 | 0                 |
|                                | 合计   | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 恒生 A           | 恒生 B           | 添富恒生             |
|-------------------------------|----------------|----------------|------------------|
| 基金合同生效日(2014 年 3 月 6 日)基金份额总额 | 109,711,438.00 | 109,711,438.00 | 1,051,208,262.98 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 149,470,400.00 | 149,470,400.00 | 162,854,258.39   |
| 本报告期基金总申购份额                   | —              | —              | 330,663,712.05   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | —              | —              | 397,533,333.89   |
| 本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)      | -49,380,084.00 | -49,380,084.00 | 107,099,093.53   |
| 本报告期末基金份额总额                   | 100,090,316.00 | 100,090,316.00 | 203,083,730.08   |

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

1. 《汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 19 日正式生效，胡昕炜先生任该基金的基金经理。
2. 《汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 25 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。
3. 《汇添富熙和精选混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 11 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。
4. 《汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生

效，陈加荣先生任该基金的基金经理。

5. 《汇添富行业整合主题混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，赵鹏程先生任该基金的基金经理。

6. 《汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，陈健玮先生和劳杰男先生任该基金的基金经理。

7. 基金管理人于 2018 年 2 月 14 日公告，增聘胡娜女士担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。

8. 基金管理人 2018 年 3 月 2 日公告，劳杰男先生不再担任汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的基金经理，由李威先生单独管理该基金。

9. 基金管理人于 2018 年 3 月 2 日公告，增聘郑慧莲女士担任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

10. 《汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 8 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。

11. 基金管理人于 2018 年 3 月 20 日公告，增聘赵鹏飞先生担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生、胡娜女士共同管理该基金。

12. 《汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 23 日正式生效，吴振翔先生和许一尊先生任该基金的基金经理。

13. 基金管理人于 2018 年 4 月 3 日公告，增聘郑慧莲女士担任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

14. 《汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 16 日正式生效，吴江宏先生和胡娜女士任该基金的基金经理。

15. 《汇添富智能制造股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 23 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。

16. 《汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 26 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。

17. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

18. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 30 天债券型证券投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

19. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 60 天债券型证

券投资基金的基金经理, 增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理, 由徐寅喆女士单独管理该基金。

20. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告, 徐寅喆女士不再担任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理, 增聘陶然先生担任该基金的基金经理, 由陶然先生单独管理该基金。

21. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告, 陆文磊先生和徐寅喆女士不再担任汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理, 增聘陶然先生担任该基金的基金经理, 由陶然先生单独管理该基金。

22. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告, 徐寅喆女士不再担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理, 增聘陶然先生担任该基金的基金经理, 由陶然先生单独管理该基金。

23. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告, 增聘徐寅喆女士担任汇添富货币市场基金的基金经理, 与蒋文玲女士共同管理该基金。

24. 基金管理人 2018 年 5 月 17 日公告, 韩贤旺先生和欧阳沁春先生不再担任汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 由杨璿先生单独管理该基金。

25. 《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) 基金合同》于 2018 年 5 月 23 日正式生效, 过蓓蓓女士任该基金的基金经理。

26. 基金管理人 2018 年 5 月 29 日公告, 聘任茹奕菡为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理助理, 协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

27. 《汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 6 月 21 日正式生效, 杨璿先生任该基金的基金经理。

28. 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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, 无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼。

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（%） |    |
| Credit Suisse |        | 113,894,200.24  | 21.79           | 34,168.28  | 8.32          | -  |
| 东方证券          |        | 1408,699,505.87 | 78.21           | 376,452.90 | 91.68         | -  |

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 |                 | 基金交易 |                 |
|---------------|------|-----------------|--------|-------------------|------|-----------------|------|-----------------|
|               | 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（%） | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例（%） |
| Credit Suisse | -    | -               | -      | -                 | -    | -               | -    | -               |
| 东方证券          | -    | -               | -      | -                 | -    | -               | -    | -               |

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- （1）基金交易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:

本基金本报告期末新增或退租交易单元。

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式                         | 法定披露日期     |
|----|---|--------------------------------|------------|
| 1  | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2017 年资产净值的公告                 | 公司网站                           | 2018-01-02 |
| 2  | 关于汇添富恒生指数分级证券投资基金之恒生 A 份额本次定期折算期间约定年基准收益率的公告      | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所      | 2018-01-03 |
| 3  | 关于汇添富恒生指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间添富恒生份额、恒生 A 份额停复牌的公告 | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所      | 2018-01-03 |
| 4  | 关于添富恒生份额、恒生 A 份额定期份额折算后复牌首日收盘价调整的公告               | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所      | 2018-01-04 |
| 5  | 关于汇添富恒生指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告                 | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所      | 2018-01-04 |
| 6  | 汇添富基金管理有限公司旗下公募基金 2017 年第 4 季度报告                  | 中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2018-01-22 |
| 7  | 关于汇添富基金管理股份有限公司旗下 93 只基金修订基金合同的公告                 | 中证报, 上交所, 证券时报, 公司网站, 深交所      | 2018-03-24 |
| 8  | 关于汇添富恒生指数分级证券投                                    | 中证报, 证券时报, 上证报,                | 2018-03-28 |

|    |  |                                |            |
|----|--|--------------------------------|------------|
|    | 资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告               | 公司网站, 深交所                      |            |
| 9  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下 93 只基金 2017 年年度报告              | 中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2018-03-28 |
| 10 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加工商银行开展的费率优惠活动的公告        | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站           | 2018-03-30 |
| 11 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加电盈基金为代销机构并参与费率优惠活动的公告   | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站           | 2018-04-09 |
| 12 | 汇添富恒生指数分级证券投资基金更新招募说明书(2018 年第 1 号)            | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所      | 2018-04-20 |
| 13 | 汇添富基金旗下 99 只基金 2018 年第 1 季度报告                  | 中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2018-04-21 |
| 14 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加杭州银行为代销机构并参与费率优惠活动的公告   | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站           | 2018-05-16 |
| 15 | 关于汇添富恒生指数分级证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告 | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所      | 2018-05-18 |
| 16 | 关于汇添富恒生指数分级证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告 | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所      | 2018-06-28 |
| 17 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2018 半年资产净值的公告             | 中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站           | 2018-06-30 |

## § 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。



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富恒生指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富恒生指数分级证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 19-22 楼 汇添富基金管理股份有限公司

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2018 年 08 月 25 日