

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金  
(LOF)  
2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2018 年 8 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。

基金托管人招商证券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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>19</b>
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	22
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	61
7.7 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.....	61
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	61
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
7.12 投资组合报告附注.....	62
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>64</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
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.....	65
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	66
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>67</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>68</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	68
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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	71

---

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>74</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 .....	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>75</b>
12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点.....	75
12.3 查阅方式.....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)	
基金简称	汇添富中证 500 指数 (LOF)	
基金主代码	501036	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 8 月 10 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	215,724,169.43 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	2017 年 10 月 9 日	
下属分级基金的基金简称:	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
下属分级基金场内简称:	中证 500A	中证 500C
下属分级基金的交易代码:	501036	501037
报告期末下属分级基金的份额总额	132,472,911.11 份	83,251,258.32 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。
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 500 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	招商证券股份有限公司

		公司	
信息披露负责人	姓名	李鹏	郭杰
	联系电话	021-28932888	0755-82943666
	电子邮箱	service@99fund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95565
传真		021-28932998	0755-82960794
注册地址		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 19-22 层	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层
邮政编码		200120	518026
法定代表人		李文	霍达

## 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》、《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 层 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

基金级别	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,934,458.45	-3,082,868.22
本期利润	-18,153,058.65	-10,770,951.70
加权平均基金份额本期利润	-0.1314	-0.1348
本期加权平均净值利润率	-14.37%	-14.78%
本期基金份额净值增长率	-14.42%	-14.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-24,678,674.72	-15,604,333.53
期末可供分配基金份额利润	-0.1863	-0.1874
期末基金资产净值	107,794,236.39	67,646,924.79
期末基金份额净值	0.8137	0.8126
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-18.63%	-18.74%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证 500 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	-8.36%	1.76%	-8.86%	1.77%	0.50%	-0.01%
过去三个月	-12.94%	1.31%	-13.96%	1.31%	1.02%	0.00%
过去六个月	-14.42%	1.37%	-15.71%	1.37%	1.29%	0.00%



自基金合同生效日起至今	-18.63%	1.13%	-16.81%	1.17%	-1.82%	-0.04%
-------------	---------	-------	---------	-------	--------	--------

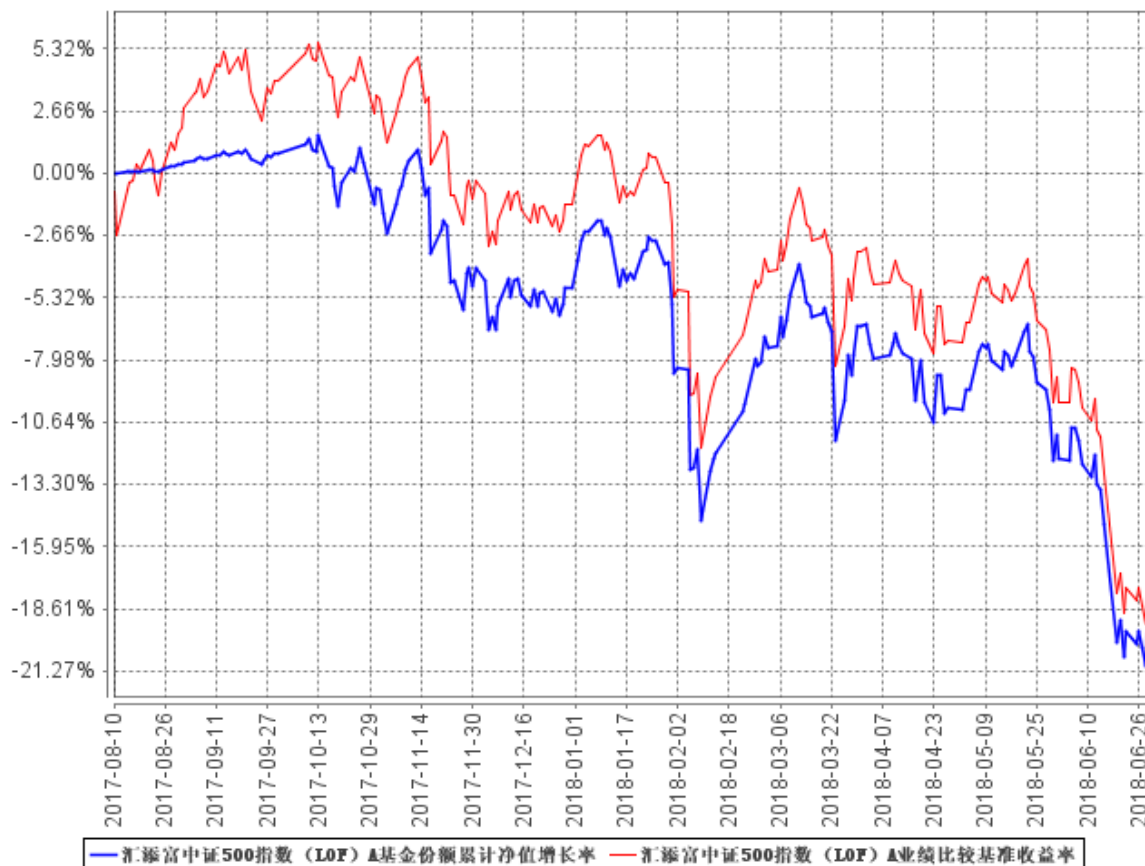
汇添富中证 500 指数 (LOF) C

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	-8.37%	1.76%	-8.86%	1.77%	0.49%	-0.01%
过去三个月	-12.98%	1.31%	-13.96%	1.31%	0.98%	0.00%
过去六个月	-14.50%	1.37%	-15.71%	1.37%	1.21%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-18.74%	1.13%	-16.81%	1.17%	-1.93%	-0.04%

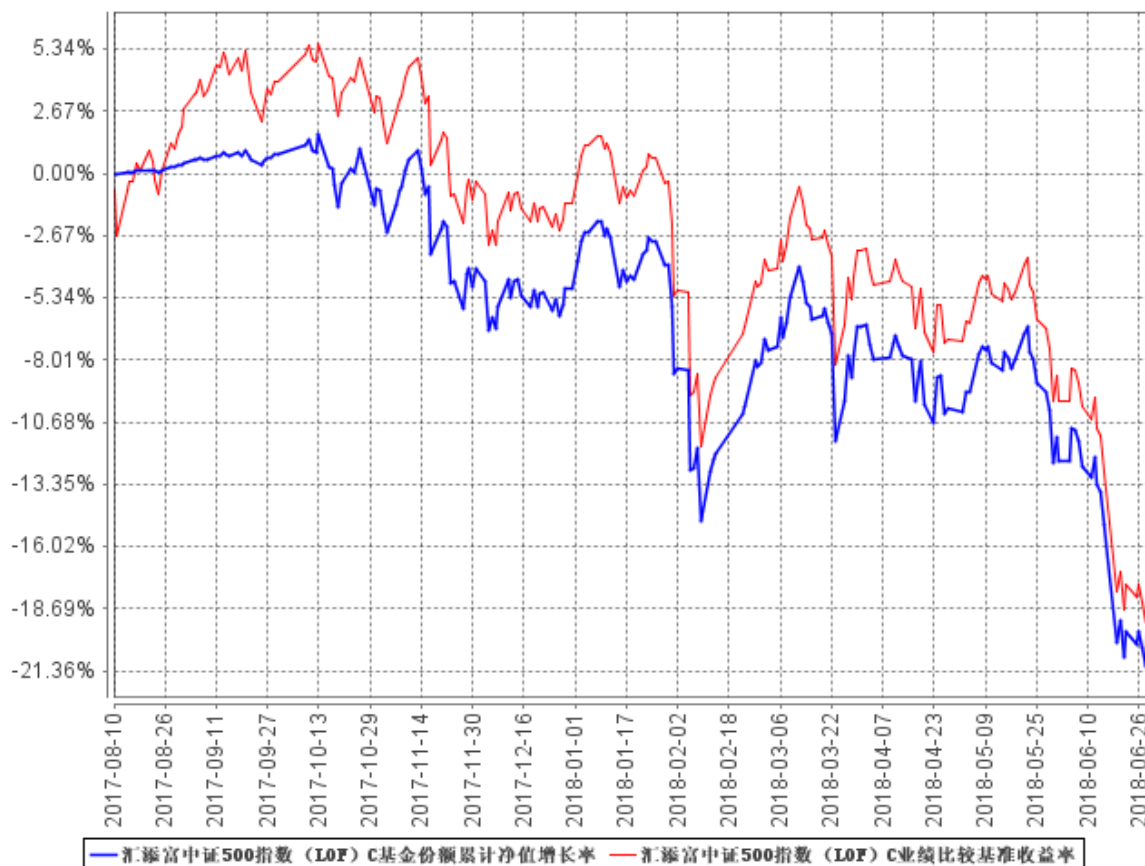
注：本基金的《基金合同》生效日为 2017 年 08 月 10 日，至本报告期末未满 1 年。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富中证500指数 (LOF) A基金份额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



汇添富中证500指数（LOF）C基金份额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：本基金的《基金合同》生效日为2017年08月10日，至本报告期末未满1年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年08月10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		
吴振翔	汇添富上证综合指数、汇添富沪深 300 安中指数基金、汇添富成长多因子股票基金、汇添富主要消费 ETF 联接基金、汇添富中证精准医指数基金、中证上海国企 ETF、汇添富中证互联网医疗指数 (LOF)、汇添富中证 500 指数(LOF)、添富价值多因子股票的基金经理，指数与量化投资部副总监。	2017 年 8 月 10 日	-	12 年	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 5 日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金的基金经理，2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理，2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费 ETF 基金、中证医药卫生 ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金的基金经理，2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中指数基金的基金经理，2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理，2015 年 3 月 24 日至今任汇添富主要消费 ETF 联接基金的基金经理，2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金

					经理，2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理，2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗指数（LOF）的基金经理，2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数（LOF）的基金经理，2018 年 3 月 23 日至今任添富价值多因子股票的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的交易次数为 4 次，由于组合投资策略导致。经检查和分

析未发现异常情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2018 年上半年，基本上，经济保持韧性，企业盈利整体向好，贸易维持较高景气度，出口转好。于此同时，金融监管保持定力，流动性结构性偏紧。市场涨跌的主要影响因素包括：上市公司业绩、中美贸易摩擦的反复和大国博弈深化、去杠杆伴随的资金面收紧及信用风险暴露、汇率波动影响海外投资者对人民币资产的风险偏好。

风格上，市值角度，中小市值公司受宏观流动性影响相对较大，财务不确定性高，下跌幅度整体更大；基本面角度，在去杠杆和强监管背景下，财务质地优良、杠杆率合理、盈利能力强、现金流充裕、增长确定性高、基本面与估值匹配度较好的高质量公司具有一定超额收益。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位报告期内基本保持在 90%~95%之间，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 500 指数（LOF）A 基金份额净值为 0.8137 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.42%；截至本报告期末汇添富中证 500 指数（LOF）C 基金份额净值为 0.8126 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.50%；同期业绩比较基准收益率为-15.71%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中美贸易摩擦以及国内去杠杆的节奏和力度仍是影响市场的主要变量，在此背景下，内需的韧性和经济结构转型的进度可能成为市场的关注点。当前 A 股整体估值水平处于历史低位，较为充分地反应了市场预期，具备长期投资价值。长期看，贸易争端和去杠杆均是产业升级过程中的必经之路。随着国内经济结构的逐步调整、潜在金融风险的逐步化解、市场透明度的逐步提升，积极因素将逐渐显现，从而改善整体风险偏好，带来新的热点和投资机会。

风格上，A 股有进一步向成熟市场靠拢的可能性，基本面质地优良的股票仍具有核心配置价值。在众多外部变量作用下，风格和行业的切换可能更为频繁。随着市场的逐步企稳，市场关注点很可能从安全性转向长期的成长性上。

作为指数基金，将严格遵守基金合同，继续坚持既定的指数化投资策略，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，实现有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，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。

#### 4.7 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基金份额，可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。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。



本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、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方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 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 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	13,660,621.52	12,501,026.91
结算备付金		769,899.22	1,248,640.12
存出保证金		932,948.24	592,135.78
交易性金融资产	6.4.7.2	159,196,263.68	212,654,271.01
其中：股票投资		159,183,583.48	212,337,428.18
基金投资		-	-
债券投资		12,680.20	316,842.83
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		-	243,095.06
应收利息	6.4.7.5	17,937.46	8,786.41
应收股利		-	-
应收申购款		1,605,837.78	42,918.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		176,183,507.90	227,290,873.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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		-	-
应付赎回款		253,022.92	997,705.72
应付管理人报酬		73,827.44	97,534.98
应付托管费		14,765.50	19,506.99
应付销售服务费		14,039.45	16,771.46
应付交易费用	6.4.7.7	148,254.12	308,424.00

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	238,437.29	206,314.17
负债合计		742,346.72	1,646,257.32
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	215,724,169.43	237,344,583.44
未分配利润	6.4.7.10	-40,283,008.25	-11,699,966.79
所有者权益合计		175,441,161.18	225,644,616.65
负债和所有者权益总计		176,183,507.90	227,290,873.97

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，其中下属 A 类基金份额参考净值 0.8137 元，份额总额 132,472,911.11 份；下属 C 类基金份额参考净值 0.8126 元，份额总额 83,251,258.32 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-27,743,163.91
1.利息收入		109,185.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	109,071.75
债券利息收入		113.87
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）		-6,969,162.74
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-7,981,060.14
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	32,621.80
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-154,520.00
股利收益	6.4.7.16	1,133,795.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-20,906,683.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	23,496.89

列)		
<b>减：二、费用</b>		1,180,846.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	493,038.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	98,607.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	90,177.30
4. 交易费用	6.4.7.19	290,308.85
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.12
7. 其他费用	6.4.7.20	208,713.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-28,924,010.35

注：本基金合同于 2017 年 08 月 10 日生效，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示本期数据，特此说明。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	237,344,583.44	-11,699,966.79	225,644,616.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-28,924,010.35	-28,924,010.35
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）	-21,620,414.01	340,968.89	-21,279,445.12
其中：1.基金申购款	86,032,958.02	-8,593,277.84	77,439,680.18
2.基金赎回款	-107,653,372.03	8,934,246.73	-98,719,125.30
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)	215,724,169.43	-40,283,008.25	175,441,161.18

注：本基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效，无比较式的上年可比期间，因此所有者权益（基金净值）变动表只列示本期数据，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____张晖_____	_____李骁_____	_____雷青松_____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 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]770 号文《关于准予汇添富中证 500 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作为基金发起人于 2017 年 7 月 26 日至 2017 年 8 月 7 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\_B29 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 8 月 10 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 735,669,673.64 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 135,015.99 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 735,804,689.63 元，折合 735,804,689.63 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，基金托管人为招商证券股份有限公司。

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(但须符合中国证监会的相关规定)。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。本基金的业绩比较基准为：中证 500 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已



纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；

持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	13,660,621.52
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：	13,660,621.52

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	189,503,485.89	159,183,583.48	-30,319,902.41
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	12,680.20	-319.80
	银行间市场	-	-
	合计	12,680.20	-319.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	189,516,485.89	159,196,263.68	-30,320,222.21

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义金 额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	4,504,000.00	-	-	
股指期货投资	4,504,000.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	4,504,000.00	-	-	

注：本期末 2018 年 6 月 30 日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量(买/卖)	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
IC1809	4.00	4,504,000.00	4,090,080.00	-413,920.00
总额合计：		-413,920.00		
加：可抵销期货暂收款		413,920.00		
股指期货投资净额：		0.00		

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

**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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,864.82
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	12,052.10
应收债券利息	5.64
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	14.90
合计	17,937.46

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 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 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	148,254.12
银行间市场应付交易费用	-
合计	148,254.12

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付信息披露费	188,765.71
应付审计费	39,671.58
应付指数使用费	10,000.00
合计	238,437.29

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	156,313,569.85	156,313,569.85
本期申购	28,377,450.96	28,377,450.96
本期赎回(以“-”号填列)	-52,218,109.70	-52,218,109.70

本期末	132,472,911.11	132,472,911.11
-----	----------------	----------------

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) C		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	81,031,013.59	81,031,013.59
本期申购	57,655,507.06	57,655,507.06
本期赎回(以“-”号填列)	-55,435,262.33	-55,435,262.33
本期末	83,251,258.32	83,251,258.32

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-172,727.54	-7,511,548.36	-7,684,275.90
本期利润	-4,934,458.45	-13,218,600.20	-18,153,058.65
本期基金份额交易产生的变动数	-30,003.87	1,188,663.70	1,158,659.83
其中：基金申购款	-462,174.05	-2,773,157.83	-3,235,331.88
基金赎回款	432,170.18	3,961,821.53	4,393,991.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,137,189.86	-19,541,484.86	-24,678,674.72

单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-121,930.11	-3,893,760.78	-4,015,690.89
本期利润	-3,082,868.22	-7,688,083.48	-10,770,951.70
本期基金份额交易产生的变动数	-127,781.79	-689,909.15	-817,690.94
其中：基金申购款	-558,495.20	-4,799,450.76	-5,357,945.96
基金赎回款	430,713.41	4,109,541.61	4,540,255.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,332,580.12	-12,271,753.41	-15,604,333.53

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	96,359.91
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	10,491.82
其他	2,220.02
合计	109,071.75

注：其中“其他”为直销申购款利息收入和交易保证金利息收入。

### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	104,817,146.91
减：卖出股票成本总额	112,798,207.05
买卖股票差价收入	-7,981,060.14

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	32,621.80
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	32,621.80

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	515,334.51

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	482,500.00
减：应收利息总额	212.71
买卖债券差价收入	32,621.80

### 6.4.7.13.3 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。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

#### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	-154,520.00

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,133,795.60
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,133,795.60

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-20,470,763.68
——股票投资	-20,440,401.05

——债券投资	-30,362.63
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-435,920.00
——权证投资	-
股指期货	-435,920.00
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	-20,906,683.68

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	23,496.89
合计	23,496.89

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	290,308.85
银行间市场交易费用	-
合计	290,308.85

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
账户维护费	-
指数使用费	20,276.34
合计	208,713.63



## 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，本基金无其他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、基金销售机构、基金发起人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	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。

### 6.4.10 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
招商证券股份有限公司	183,404,578.91	100.00%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
招商证券股份有限公司	515,334.51	100.00%

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	168,808.10	100.00%	148,254.12	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 6.4.10.2 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 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	493,038.75
其中：支付销售机构的客户维护费	25,505.40

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日

结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	98,607.79

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
招商证券股份有限公司	0.00	101.08	101.08
汇添富基金管理股份有限公司	0.00	3,995.91	3,995.91
东方证券股份有限公司	0.00	37,745.47	37,745.47
合计	0.00	41,842.46	41,842.46

注：本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的基金销售服务费年费率为 0.25%。

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

### 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：本基金本报告期末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

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
基金合同生效日 ( 2017 年 8 月 10 日 ) 持有的基金份额	10,002,700.27	-
期初持有的基金份额	10,002,700.27	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,002,700.27	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	7.5508%	-

注：本基金于 2017 年 8 月 10 日成立。本公司于 2017 年 8 月 2 日用自有资金 10,001,000.00 元认购本基金 10,002,700.27 份 (基金成立时利息结转的份额为 2,700.27 份)，认购费用 1000.00 元。符合招募说明书规定的认购费率。

#### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	13,660,621.52	96,359.91

**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：本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018 年 6 月 25 日	2018 年 7 月 3 日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018 年 6 月 29 日	-	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额
000825	太钢不锈	2018 年 4 月 16 日	重大资产重组停牌	6.00	-	-	104,800	537,128.12	628,800.00
600022	山东钢铁	2018 年 3 月 27 日	重大资产重组停牌	2.02	2018 年 8 月 16 日	1.83	310,800	760,684.84	627,816.00
000566	海南海药	2017 年 11 月 22 日	重大资产重组停牌	13.01	2018 年 7 月 9 日	11.60	45,700	602,073.62	594,557.00
300146	汤臣倍健	2018 年 1 月 31 日	重大资产重组停牌	16.60	2018 年 7 月 31 日	16.50	34,800	483,099.51	577,680.00
600811	东方集团	2018 年 5 月 30 日	重大事项停牌	4.30	-	-	133,200	638,918.30	572,760.00
300266	兴源环境	2018 年 2 月 5 日	重大资产重组停牌	16.67	2018 年	17.99	29,400	849,334.21	490,098.00

		日	组停牌		7月2日					
002408	齐翔腾达	2018年6月19日	重大资产重组停牌	12.28	-	-	39,600	485,624.87	486,288.00	
002359	北讯集团	2018年5月21日	重大资产重组停牌	19.58	2018年8月21日	17.62	24,300	540,703.55	475,794.00	
600751	海航科技	2018年1月12日	重大资产重组停牌	6.49	-	-	63,500	395,314.17	412,115.00	
002051	中工国际	2018年4月9日	重大资产重组停牌	15.27	-	-	26,300	532,374.96	401,601.00	
002147	新光圆成	2018年1月18日	重大资产重组停牌	14.76	-	-	26,910	347,019.17	397,191.60	
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大资产重组停牌	9.49	-	-	39,487	428,022.48	374,731.63	
600158	中体产业	2018年3月27日	重大资产重组停牌	11.64	2018年7月16日	11.61	31,800	451,860.32	370,152.00	
000939	凯迪生态	2017年11月16日	重大事项停牌	4.04	2018年7月2日	4.74	91,100	498,839.96	368,044.00	
600086	东方金钰	2018年1月19日	重大资产重组停牌	10.04	-	-	33,100	346,288.44	332,324.00	
002426	胜利精密	2018年6月19日	重大事项停牌	3.60	2018年7月3日	3.26	92,300	370,709.00	332,280.00	
002573	清新环境	2018年6月19日	重大事项停牌	11.55	-	-	28,700	534,909.83	331,485.00	
002665	首航节能	2018年5月29日	重大资产重组停牌	5.80	-	-	56,900	456,131.21	330,020.00	
300197	铁汉生态	2018年5月28日	重大资产重组停牌	5.37	-	-	60,150	495,334.40	323,005.50	
002431	棕榈股份	2018年5月30日	重大事项停牌	6.71	-	-	46,800	471,617.15	314,028.00	
600122	宏图高科	2018年6月19日	重大资产重组停牌	7.40	-	-	41,300	377,268.82	305,620.00	
002512	达华智能	2018年6月19日	重大事项停牌	9.70	-	-	29,300	534,848.70	284,210.00	
002477	雏鹰农牧	2018年6月14日	重大事项停牌	3.31	-	-	84,000	379,527.25	278,040.00	
002699	美盛文化	2018年2月5日	重大资产重组停牌	18.76	2018年7月2日	16.88	13,300	236,186.55	249,508.00	
000426	兴业矿业	2018年6月19日	重大资产重组停牌	7.21	-	-	33,400	304,932.90	240,814.00	
002005	德豪润达	2018年1月2日	重大资产重组停牌	4.36	2018年7月2日	3.92	54,600	268,591.81	238,056.00	

002437	誉衡药业	2018 年 6 月 11 日	重大资产重组停牌	6.20	2018 年 8 月 13 日	5.57	38,200	264,454.23	236,840.00
600750	江中药业	2018 年 5 月 2 日	重大资产重组停牌	17.75	2018 年 8 月 1 日	16.12	11,900	258,707.91	211,225.00
600759	洲际油气	2018 年 3 月 27 日	重大资产重组停牌	3.94	-	-	53,600	291,172.48	211,184.00
600335	国机汽车	2018 年 4 月 3 日	重大事项停牌	10.43	-	-	19,300	251,052.99	201,299.00
600848	上海临港	2018 年 6 月 15 日	重大资产重组停牌	21.67	-	-	9,000	217,761.69	195,030.00
000587	金洲慈航	2018 年 6 月 15 日	重大事项停牌	4.96	2018 年 7 月 2 日	4.46	38,100	295,983.01	188,976.00
600687	刚泰控股	2018 年 6 月 11 日	重大资产重组停牌	9.09	2018 年 8 月 20 日	8.18	19,402	259,891.97	176,364.18
002011	盾安环境	2018 年 5 月 2 日	重大资产重组停牌	6.40	-	-	25,500	275,411.13	163,200.00
000669	金鸿控股	2018 年 5 月 18 日	重大资产重组停牌	7.25	2018 年 8 月 6 日	6.53	21,841	258,660.71	158,347.25

### 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

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金融资产款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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金融资产款余额。

### 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

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约责任，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。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；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。

##### 6.4.13.3.1 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、债券投资、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	13,660,621.52	-	-	-	-	-	13,660,621.52
结算备付金	769,899.22	-	-	-	-	-	769,899.22
存出保证金	33,130.64	-	-	-	-	899,817.60	932,948.24
交易性金融资产	-	-	12,680.20	-	-	159,183,583.48	159,196,263.68
应收证券清算款	-	-	-	-	-	413,920.00	413,920.00
应收利息	-	-	-	-	-	17,937.46	17,937.46
应收申购款	1,178,883.60	-	-	-	-	426,954.18	1,605,837.78
其他资产	-	-	-	-	-	-413,920.00	-413,920.00
资产总计	15,642,534.98	-	12,680.20	-	-	160,528,292.72	176,183,507.90
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	253,022.92	253,022.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	73,827.44	73,827.44
应付托管费	-	-	-	-	-	14,765.50	14,765.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	14,039.45	14,039.45
应付交易费用	-	-	-	-	-	148,254.12	148,254.12
其他负债	-	-	-	-	-	238,437.29	238,437.29
负债总计	-	-	-	-	-	742,346.72	742,346.72
利率敏感度缺口	15,642,534.98	-	12,680.20	-	-	-159,785,946.00	175,441,161.18
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产						
银行存款	12,501,026.91	-	-	-	-	12,501,026.91
结算备付金	1,248,640.12	-	-	-	-	1,248,640.12
存出保证金	318,807.78	-	-	-	273,328.00	592,135.78
交易性金融资产	-	-	316,842.83	-	-212,337,428.18	212,654,271.01
应收证券清算款	-	-	-	-	243,095.06	243,095.06
应收利息	-	-	-	-	8,786.41	8,786.41
应收申购款	37,175.93	-	-	-	5,742.75	42,918.68
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	14,105,650.74	-	316,842.83	-	-212,868,380.40	227,290,873.97
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	-	0.00
应付赎回款	-	-	-	-	997,705.72	997,705.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	97,534.98	97,534.98
应付托管费	-	-	-	-	19,506.99	19,506.99
应付销售服务费	-	-	-	-	16,771.46	16,771.46
应付交易费用	-	-	-	-	308,424.00	308,424.00
其他负债	-	-	-	-	206,314.17	206,314.17
负债总计	-	-	-	-	1,646,257.32	1,646,257.32
利率敏感度缺口	14,105,650.74	-	316,842.83	-	-211,222,123.08	225,644,616.65

注：上表统计了本基金资产和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：本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，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

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大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 其他价格风险的敏感性分析**

注：于 2018 年 06 月 30 日，本基金成立未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### **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	159,183,583.48	90.35
	其中：股票	159,183,583.48	90.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,680.20	0.01
	其中：债券	12,680.20	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,430,520.74	8.19
8	其他各项资产	2,556,723.48	1.45
9	合计	176,183,507.90	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,680,287.00	0.96
B	采矿业	4,907,873.01	2.80
C	制造业	92,639,990.31	52.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,613,563.68	2.63
E	建筑业	2,632,934.50	1.50
F	批发和零售业	8,728,046.43	4.97
G	交通运输、仓储和邮政业	5,355,741.70	3.05
H	住宿和餐饮业	861,171.96	0.49
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,476,413.93	8.25
J	金融业	3,604,189.32	2.05

K	房地产业	8,410,967.90	4.79
L	租赁和商务服务业	2,835,235.33	1.62
M	科学研究和技术服务业	264,016.08	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	1,329,137.30	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	109,692.00	0.06
Q	卫生和社会工作	233,842.01	0.13
R	文化、体育和娱乐业	3,266,375.50	1.86
S	综合	1,274,008.00	0.73
	合计	157,223,485.96	89.62

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	736,068.88	0.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	597,951.10	0.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	312,099.90	0.18
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	79,391.50	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	153,360.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	1,960,097.52	1.12

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000661	长春高新	6,101	1,389,197.70	0.79
2	603019	中科曙光	22,579	1,035,698.73	0.59
3	600426	华鲁恒升	56,300	990,317.00	0.56
4	600521	华海药业	33,540	895,182.60	0.51
5	600201	生物股份	52,378	895,140.02	0.51
6	002049	紫光国微	19,001	838,324.12	0.48
7	002410	广联达	30,000	831,900.00	0.47
8	000977	浪潮信息	34,600	825,210.00	0.47
9	600584	长电科技	48,700	824,978.00	0.47
10	603589	口子窖	13,400	823,430.00	0.47
11	600298	安琪酵母	22,101	788,563.68	0.45
12	000830	鲁西化工	45,793	782,144.44	0.45
13	000703	恒逸石化	51,579	767,495.52	0.44
14	600256	广汇能源	180,630	738,776.70	0.42
15	002340	格林美	119,400	722,370.00	0.41
16	601233	桐昆股份	40,733	701,422.26	0.40
17	002038	双鹭药业	18,399	698,978.01	0.40
18	600872	中炬高新	24,904	697,312.00	0.40
19	002179	中航光电	17,702	690,378.00	0.39
20	600673	东阳光科	66,200	683,846.00	0.39
21	600879	航天电子	97,200	683,316.00	0.39
22	600600	青岛啤酒	15,500	679,365.00	0.39
23	600760	中航沈飞	18,800	677,552.00	0.39
24	002268	卫士通	30,930	675,201.90	0.38
25	002078	太阳纸业	69,600	674,424.00	0.38
26	600884	杉杉股份	29,600	654,160.00	0.37
27	002129	中环股份	82,700	647,541.00	0.37
28	002589	瑞康医药	47,100	642,444.00	0.37
29	000825	太钢不锈	104,800	628,800.00	0.36
30	600022	山东钢铁	310,800	627,816.00	0.36

31	300253	卫宁健康	50,600	626,934.00	0.36
32	600525	长园集团	59,200	625,744.00	0.36
33	002439	启明星辰	29,200	619,624.00	0.35
34	000636	风华高科	38,900	617,732.00	0.35
35	600642	申能股份	122,100	612,942.00	0.35
36	600004	白云机场	46,300	606,067.00	0.35
37	300383	光环新网	45,000	603,450.00	0.34
38	600885	宏发股份	20,041	599,626.72	0.34
39	000418	小天鹅 A	8,602	596,548.70	0.34
40	600258	首旅酒店	21,900	595,023.00	0.34
41	000566	海南海药	45,700	594,557.00	0.34
42	600315	上海家化	15,000	594,450.00	0.34
43	002013	中航机电	77,650	587,810.50	0.34
44	600325	华发股份	75,700	585,161.00	0.33
45	002465	海格通信	72,200	579,766.00	0.33
46	000581	威孚高科	26,200	579,282.00	0.33
47	300146	汤臣倍健	34,800	577,680.00	0.33
48	000860	顺鑫农业	15,402	577,575.00	0.33
49	000656	金科股份	119,400	573,120.00	0.33
50	600811	东方集团	133,200	572,760.00	0.33
51	600808	马钢股份	159,200	571,528.00	0.33
52	000066	中国长城	79,100	562,401.00	0.32
53	600079	人福医药	42,395	560,461.90	0.32
54	000513	丽珠集团	12,711	558,648.45	0.32
55	002092	中泰化学	57,600	555,264.00	0.32
56	000975	银泰资源	54,320	550,804.80	0.31
57	000690	宝新能源	78,000	542,880.00	0.31
58	600183	生益科技	58,945	539,936.20	0.31
59	601168	西部矿业	85,200	535,056.00	0.30
60	600282	南钢股份	119,200	526,864.00	0.30
61	000039	中集集团	39,600	525,888.00	0.30
62	002223	鱼跃医疗	26,900	524,281.00	0.30
63	600138	中青旅	26,000	518,180.00	0.30
64	002127	南极电商	54,804	514,609.56	0.29
65	300315	掌趣科技	123,100	514,558.00	0.29
66	000488	晨鸣纸业	39,800	514,216.00	0.29
67	603369	今世缘	22,400	511,392.00	0.29
68	002195	二三四五	119,270	510,475.60	0.29
69	002176	江特电机	52,500	510,300.00	0.29

70	600260	凯乐科技	19,000	509,960.00	0.29
71	600718	东软集团	38,900	508,034.00	0.29
72	600528	中铁工业	49,600	506,912.00	0.29
73	000997	新大陆	31,600	497,700.00	0.28
74	002110	三钢闽光	30,700	492,121.00	0.28
75	600392	盛和资源	30,200	490,146.00	0.28
76	300266	兴源环境	29,400	490,098.00	0.28
77	300010	立思辰	40,000	489,600.00	0.28
78	000999	华润三九	17,500	487,025.00	0.28
79	002408	齐翔腾达	39,600	486,288.00	0.28
80	300418	昆仑万维	25,700	485,216.00	0.28
81	300166	东方国信	32,893	484,513.89	0.28
82	600967	内蒙一机	37,800	481,572.00	0.27
83	600062	华润双鹤	19,500	478,725.00	0.27
84	300088	长信科技	82,300	477,340.00	0.27
85	000887	中鼎股份	33,100	476,971.00	0.27
86	600643	爱建集团	50,700	476,580.00	0.27
87	002019	亿帆医药	27,000	476,550.00	0.27
88	002359	北讯集团	24,300	475,794.00	0.27
89	300287	飞利信	65,900	473,821.00	0.27
90	600839	四川长虹	165,400	473,044.00	0.27
91	000750	国海证券	131,800	470,526.00	0.27
92	600060	海信电器	35,100	469,989.00	0.27
93	000009	中国宝安	95,900	469,910.00	0.27
94	002384	东山精密	19,115	458,760.00	0.26
95	000778	新兴铸管	106,900	457,532.00	0.26
96	600729	重庆百货	13,801	454,742.95	0.26
97	000681	视觉中国	15,702	450,647.40	0.26
98	600160	巨化股份	61,260	448,423.20	0.26
99	000930	中粮生化	43,200	444,960.00	0.25
100	002183	怡亚通	66,400	441,560.00	0.25
101	600056	中国医药	23,900	436,653.00	0.25
102	300182	捷成股份	57,600	436,608.00	0.25
103	000732	泰禾集团	22,300	433,735.00	0.25
104	002221	东华能源	44,200	431,834.00	0.25
105	600410	华胜天成	49,200	430,500.00	0.25
106	600460	士兰微	35,200	429,440.00	0.24
107	600388	龙净环保	33,500	428,130.00	0.24
108	002373	千方科技	32,800	428,040.00	0.24



109	600572	康恩贝	59,600	427,332.00	0.24
110	600655	豫园股份	45,000	425,250.00	0.24
111	002506	协鑫集成	90,600	424,008.00	0.24
112	000729	燕京啤酒	63,000	423,990.00	0.24
113	600166	福田汽车	208,500	423,255.00	0.24
114	600380	健康元	35,100	416,286.00	0.24
115	002640	跨境通	27,700	416,054.00	0.24
116	600536	中国软件	19,201	415,317.63	0.24
117	600755	厦门国贸	56,900	414,801.00	0.24
118	300055	万邦达	36,000	413,640.00	0.24
119	600751	海航科技	63,500	412,115.00	0.23
120	600094	大名城	71,400	411,264.00	0.23
121	603077	和邦生物	236,600	409,318.00	0.23
122	300274	阳光电源	45,500	408,135.00	0.23
123	002371	北方华创	8,201	407,343.67	0.23
124	601098	中南传媒	32,100	405,744.00	0.23
125	002407	多氟多	28,900	405,178.00	0.23
126	000686	东北证券	62,900	403,189.00	0.23
127	002051	中工国际	26,300	401,601.00	0.23
128	002028	思源电气	23,800	399,602.00	0.23
129	600895	张江高科	34,700	399,050.00	0.23
130	002273	水晶光电	30,924	397,991.88	0.23
131	002147	新光圆成	26,910	397,191.60	0.23
132	600409	三友化工	46,100	396,921.00	0.23
133	002174	游族网络	19,900	396,010.00	0.23
134	600266	北京城建	42,100	395,740.00	0.23
135	600291	西水股份	29,400	392,784.00	0.22
136	000988	华工科技	27,000	390,150.00	0.22
137	603899	晨光文具	12,300	389,787.00	0.22
138	600499	科达洁能	56,500	387,590.00	0.22
139	600418	江淮汽车	59,200	385,392.00	0.22
140	002030	达安基因	24,970	385,037.40	0.22
141	600348	阳泉煤业	53,800	384,670.00	0.22
142	600787	中储股份	49,300	381,582.00	0.22
143	002603	以岭药业	27,000	377,460.00	0.22
144	000528	柳工	35,200	376,992.00	0.21
145	600161	天坛生物	19,473	376,802.55	0.21
146	600267	海正药业	25,900	376,586.00	0.21
147	300324	旋极信息	39,487	374,731.63	0.21

148	002491	通鼎互联	33,800	374,166.00	0.21
149	000401	冀东水泥	42,100	373,427.00	0.21
150	002399	海普瑞	16,800	371,952.00	0.21
151	603885	吉祥航空	24,100	371,381.00	0.21
152	600158	中体产业	31,800	370,152.00	0.21
153	600511	国药股份	13,702	369,268.90	0.21
154	002281	光迅科技	17,405	368,986.00	0.21
155	600827	百联股份	35,900	366,180.00	0.21
156	000596	古井贡酒	4,100	363,998.00	0.21
157	600875	东方电气	49,100	363,831.00	0.21
158	600978	宜华生活	53,200	363,356.00	0.21
159	000807	云铝股份	70,000	362,600.00	0.21
160	000878	云南铜业	37,900	361,566.00	0.21
161	002244	滨江集团	69,500	361,400.00	0.21
162	002250	联化科技	40,900	360,738.00	0.21
163	002440	闰土股份	30,850	360,636.50	0.21
164	603766	隆鑫通用	65,900	357,837.00	0.20
165	000970	中科三环	38,100	356,235.00	0.20
166	000089	深圳机场	45,800	350,370.00	0.20
167	000547	航天发展	44,700	349,107.00	0.20
168	000960	锡业股份	29,000	348,290.00	0.20
169	002353	杰瑞股份	21,400	347,750.00	0.20
170	600737	中粮糖业	45,900	346,086.00	0.20
171	600649	城投控股	56,500	345,780.00	0.20
172	600143	金发科技	66,200	345,564.00	0.20
173	002517	恺英网络	48,001	345,127.19	0.20
174	002299	圣农发展	22,200	343,878.00	0.20
175	002563	森马服饰	24,000	343,200.00	0.20
176	601872	招商轮船	94,900	342,589.00	0.20
177	600125	铁龙物流	40,800	341,496.00	0.19
178	000078	海王生物	70,900	341,029.00	0.19
179	002233	塔牌集团	29,801	340,923.44	0.19
180	600270	外运发展	16,200	339,552.00	0.19
181	601966	玲珑轮胎	21,400	337,478.00	0.19
182	600179	安通控股	33,240	336,721.20	0.19
183	300133	华策影视	31,600	336,540.00	0.19
184	000028	国药一致	6,701	334,379.90	0.19
185	002280	联络互动	58,400	334,048.00	0.19
186	300058	蓝色光标	58,600	334,020.00	0.19

187	600086	东方金钰	33,100	332,324.00	0.19
188	002426	胜利精密	92,300	332,280.00	0.19
189	002366	台海核电	23,301	332,272.26	0.19
190	600216	浙江医药	26,000	332,020.00	0.19
191	002573	清新环境	28,700	331,485.00	0.19
192	000813	德展健康	40,100	330,424.00	0.19
193	002665	首航节能	56,900	330,020.00	0.19
194	600801	华新水泥	21,800	327,654.00	0.19
195	600435	北方导航	40,000	326,400.00	0.19
196	000598	兴蓉环境	80,100	325,206.00	0.19
197	300113	顺网科技	18,600	323,826.00	0.18
198	002004	华邦健康	63,700	323,596.00	0.18
199	603816	顾家家居	4,400	323,444.00	0.18
200	300197	铁汉生态	60,150	323,005.50	0.18
201	002368	太极股份	11,102	322,735.14	0.18
202	600635	大众公用	86,700	322,524.00	0.18
203	600575	皖江物流	86,800	322,028.00	0.18
204	600037	歌华有线	31,100	320,952.00	0.18
205	000553	沙隆达 A	20,300	320,943.00	0.18
206	600277	亿利洁能	61,100	320,164.00	0.18
207	002152	广电运通	54,200	318,696.00	0.18
208	300115	长盈精密	24,400	316,468.00	0.18
209	603883	老百姓	3,801	316,091.16	0.18
210	000685	中山公用	39,600	315,612.00	0.18
211	002131	利欧股份	149,892	314,773.20	0.18
212	600970	中材国际	47,100	314,628.00	0.18
213	002600	领益智造	60,600	314,514.00	0.18
214	002431	棕榈股份	46,800	314,028.00	0.18
215	601179	中国西电	91,800	313,956.00	0.18
216	603658	安图生物	3,800	313,348.00	0.18
217	002358	森源电气	20,702	311,565.10	0.18
218	601000	唐山港	132,330	310,975.50	0.18
219	600122	宏图高科	41,300	305,620.00	0.17
220	000979	中弘股份	299,570	302,565.70	0.17
221	600563	法拉电子	6,101	301,938.49	0.17
222	002191	劲嘉股份	40,100	299,547.00	0.17
223	601678	滨化股份	48,410	299,173.80	0.17
224	002745	木林森	16,800	298,872.00	0.17
225	300199	翰宇药业	20,900	298,452.00	0.17

226	600859	王府井	13,902	295,695.54	0.17
227	600863	内蒙华电	130,000	295,100.00	0.17
228	002463	沪电股份	78,900	295,086.00	0.17
229	300026	红日药业	80,700	294,555.00	0.17
230	600307	酒钢宏兴	140,000	294,000.00	0.17
231	002709	天赐材料	7,600	292,904.00	0.17
232	600598	北大荒	31,800	291,288.00	0.17
233	600021	上海电力	43,100	290,494.00	0.17
234	002815	崇达技术	18,000	289,800.00	0.17
235	600171	上海贝岭	25,000	289,500.00	0.17
236	002690	美亚光电	12,100	288,464.00	0.16
237	002701	奥瑞金	52,800	288,288.00	0.16
238	000156	华数传媒	29,700	286,308.00	0.16
239	002285	世联行	45,600	285,912.00	0.16
240	600064	南京高科	38,740	284,351.60	0.16
241	002512	达华智能	29,300	284,210.00	0.16
242	300159	新研股份	40,100	283,908.00	0.16
243	601128	常熟银行	49,600	283,712.00	0.16
244	000031	中粮地产	48,800	282,064.00	0.16
245	600717	天津港	37,400	281,622.00	0.16
246	002672	东江环保	21,502	281,461.18	0.16
247	600823	世茂股份	67,100	280,478.00	0.16
248	600503	华丽家族	71,600	279,956.00	0.16
249	002477	雏鹰农牧	84,000	278,040.00	0.16
250	000848	承德露露	26,200	277,458.00	0.16
251	000758	中色股份	61,600	277,200.00	0.16
252	600395	盘江股份	45,600	276,792.00	0.16
253	002670	国盛金控	25,498	274,613.46	0.16
254	002390	信邦制药	37,400	273,768.00	0.16
255	000738	航发控制	20,500	273,265.00	0.16
256	002642	荣之联	29,700	272,943.00	0.16
257	600835	上海机电	14,404	271,659.44	0.15
258	600582	天地科技	73,900	271,213.00	0.15
259	600881	亚泰集团	72,600	270,798.00	0.15
260	600664	哈药股份	68,200	270,754.00	0.15
261	600597	光明乳业	27,400	270,438.00	0.15
262	600614	鹏起科技	47,300	270,083.00	0.15
263	002831	裕同科技	5,400	270,000.00	0.15
264	601880	大连港	138,700	269,078.00	0.15

265	600240	华业资本	36,700	269,011.00	0.15
266	002317	众生药业	25,403	268,509.71	0.15
267	600754	锦江股份	7,201	266,148.96	0.15
268	600120	浙江东方	19,634	266,040.70	0.15
269	600017	日照港	82,700	265,467.00	0.15
270	600039	四川路桥	80,900	265,352.00	0.15
271	002128	露天煤业	29,200	264,552.00	0.15
272	002444	巨星科技	24,000	264,240.00	0.15
273	600645	中源协和	13,708	264,016.08	0.15
274	000027	深圳能源	53,100	262,314.00	0.15
275	002505	大康农业	122,500	262,150.00	0.15
276	002180	纳思达	9,500	260,870.00	0.15
277	300308	中际旭创	4,300	258,172.00	0.15
278	002056	横店东磁	36,800	257,968.00	0.15
279	300002	神州泰岳	61,400	256,038.00	0.15
280	600594	益佰制药	28,300	253,568.00	0.14
281	300001	特锐德	22,201	252,203.36	0.14
282	002400	省广集团	77,900	251,617.00	0.14
283	600623	华谊集团	25,200	251,496.00	0.14
284	002332	仙琚制药	28,700	251,125.00	0.14
285	000926	福星股份	34,800	250,212.00	0.14
286	002699	美盛文化	13,300	249,508.00	0.14
287	600936	广西广电	52,400	249,424.00	0.14
288	000718	苏宁环球	67,800	248,826.00	0.14
289	601200	上海环境	15,700	248,531.00	0.14
290	000006	深振业 A	42,300	247,878.00	0.14
291	002839	张家港行	40,500	246,645.00	0.14
292	002212	南洋股份	20,600	244,934.00	0.14
293	000012	南玻 A	49,450	244,777.50	0.14
294	000667	美好置业	114,200	243,246.00	0.14
295	600633	浙数文化	29,100	242,694.00	0.14
296	600466	蓝光发展	39,140	242,668.00	0.14
297	600908	无锡银行	41,200	242,668.00	0.14
298	002242	九阳股份	13,701	242,370.69	0.14
299	002916	深南电路	3,800	241,338.00	0.14
300	600329	中新药业	12,700	241,300.00	0.14
301	000426	兴业矿业	33,400	240,814.00	0.14
302	600557	康缘药业	19,301	238,367.35	0.14
303	002437	誉衡药业	38,200	236,840.00	0.13

304	600098	广州发展	36,600	236,070.00	0.13
305	300257	开山股份	15,401	235,481.29	0.13
306	000563	陕国投 A	69,100	234,940.00	0.13
307	600478	科力远	45,900	234,090.00	0.13
308	300244	迪安诊断	12,301	233,842.01	0.13
309	002583	海能达	28,000	233,800.00	0.13
310	002354	天神娱乐	25,100	232,426.00	0.13
311	601717	郑煤机	39,900	231,819.00	0.13
312	600993	马应龙	13,501	229,652.01	0.13
313	002249	大洋电机	53,000	228,430.00	0.13
314	000727	华东科技	121,100	227,668.00	0.13
315	600141	兴发集团	19,540	227,641.00	0.13
316	002635	安洁科技	13,202	227,074.40	0.13
317	000021	深科技	33,000	225,060.00	0.13
318	002002	鸿达兴业	48,800	224,968.00	0.13
319	000612	焦作万方	42,700	224,175.00	0.13
320	600280	中央商场	25,700	224,104.00	0.13
321	600195	中牧股份	11,501	223,694.45	0.13
322	600580	卧龙电气	28,900	220,218.00	0.13
323	002022	科华生物	18,501	219,236.85	0.12
324	002707	众信旅游	22,800	218,880.00	0.12
325	601311	骆驼股份	19,001	217,941.47	0.12
326	002254	泰和新材	19,102	217,380.76	0.12
327	600500	中化国际	31,800	216,876.00	0.12
328	002064	华峰氨纶	52,400	216,412.00	0.12
329	002424	贵州百灵	19,000	215,840.00	0.12
330	600694	大商股份	6,601	214,598.51	0.12
331	600416	湘电股份	29,700	213,543.00	0.12
332	300297	蓝盾股份	26,300	213,293.00	0.12
333	601016	节能风电	74,200	212,954.00	0.12
334	002434	万里扬	24,200	212,476.00	0.12
335	000400	许继电气	27,100	211,651.00	0.12
336	000501	鄂武商 A	17,201	211,400.29	0.12
337	000543	皖能电力	47,900	211,239.00	0.12
338	600750	江中药业	11,900	211,225.00	0.12
339	600759	洲际油气	53,600	211,184.00	0.12
340	002544	杰赛科技	15,304	209,511.76	0.12
341	601928	凤凰传媒	34,200	207,936.00	0.12
342	002048	宁波华翔	16,800	207,144.00	0.12

343	000766	通化金马	17,300	205,524.00	0.12
344	600770	综艺股份	34,800	205,320.00	0.12
345	002277	友阿股份	44,500	205,145.00	0.12
346	603000	人民网	24,700	205,010.00	0.12
347	600648	外高桥	11,200	204,736.00	0.12
348	600312	平高电气	36,299	204,726.36	0.12
349	002308	威创股份	24,600	204,180.00	0.12
350	601801	皖新传媒	26,800	203,948.00	0.12
351	000158	常山北明	29,600	203,352.00	0.12
352	600108	亚盛集团	69,900	202,011.00	0.12
353	601608	中信重工	77,500	201,500.00	0.11
354	600335	国机汽车	19,300	201,299.00	0.11
355	600777	新潮能源	91,200	199,728.00	0.11
356	000712	锦龙股份	20,000	199,600.00	0.11
357	000090	天健集团	32,160	199,392.00	0.11
358	600317	营口港	87,100	196,846.00	0.11
359	603198	迎驾贡酒	10,700	196,559.00	0.11
360	000592	平潭发展	69,200	196,528.00	0.11
361	600259	广晟有色	6,700	196,176.00	0.11
362	002503	搜于特	55,800	195,300.00	0.11
363	600848	上海临港	9,000	195,030.00	0.11
364	000980	众泰汽车	27,400	194,814.00	0.11
365	000937	冀中能源	47,400	194,814.00	0.11
366	600611	大众交通	48,900	194,622.00	0.11
367	600073	上海梅林	29,300	194,552.00	0.11
368	002509	天广中茂	66,700	194,097.00	0.11
369	002073	软控股份	33,500	192,625.00	0.11
370	600565	迪马股份	65,000	191,750.00	0.11
371	002657	中科金财	12,100	191,664.00	0.11
372	600366	宁波韵升	31,420	191,662.00	0.11
373	600422	昆药集团	24,600	190,650.00	0.11
374	601689	拓普集团	9,802	190,550.88	0.11
375	000062	深圳华强	9,700	190,120.00	0.11
376	000877	天山股份	28,100	189,675.00	0.11
377	000587	金洲慈航	38,100	188,976.00	0.11
378	600169	太原重工	80,400	188,136.00	0.11
379	600869	智慧能源	39,800	187,856.00	0.11
380	600578	京能电力	60,200	187,824.00	0.11
381	601001	大同煤业	37,400	185,504.00	0.11

382	603659	璞泰来	2,900	185,281.00	0.11
383	002302	西部建设	17,000	183,090.00	0.10
384	603228	景旺电子	3,701	182,977.44	0.10
385	600151	航天机电	45,000	182,700.00	0.10
386	603188	亚邦股份	17,900	182,580.00	0.10
387	600338	西藏珠峰	8,801	182,356.72	0.10
388	600765	中航重机	24,400	181,536.00	0.10
389	600874	创业环保	19,402	181,214.68	0.10
390	002428	云南锗业	23,400	180,648.00	0.10
391	000762	西藏矿业	18,700	180,081.00	0.10
392	600316	洪都航空	19,201	178,953.32	0.10
393	000600	建投能源	32,000	178,240.00	0.10
394	000572	海马汽车	51,700	177,331.00	0.10
395	002489	浙江永强	48,700	177,268.00	0.10
396	002251	步步高	15,500	176,390.00	0.10
397	600687	刚泰控股	19,402	176,364.18	0.10
398	000829	天音控股	23,800	174,454.00	0.10
399	002345	潮宏基	20,200	173,720.00	0.10
400	002093	国脉科技	22,403	172,727.13	0.10
401	000541	佛山照明	28,790	172,452.10	0.10
402	000969	安泰科技	27,300	170,625.00	0.10
403	002681	奋达科技	19,700	170,602.00	0.10
404	600300	维维股份	51,900	169,194.00	0.10
405	000536	华映科技	61,400	168,850.00	0.10
406	600187	国中水务	58,800	166,992.00	0.10
407	600155	宝硕股份	23,200	166,808.00	0.10
408	300273	和佳股份	24,601	166,794.78	0.10
409	603444	吉比特	1,300	166,127.00	0.09
410	300039	上海凯宝	28,600	165,880.00	0.09
411	600393	粤泰股份	45,600	165,072.00	0.09
412	002266	浙富控股	44,000	165,000.00	0.09
413	002011	盾安环境	25,500	163,200.00	0.09
414	002118	紫鑫药业	22,800	163,020.00	0.09
415	000061	农产品	30,100	162,540.00	0.09
416	002482	广田集团	27,200	162,384.00	0.09
417	002155	湖南黄金	23,600	161,424.00	0.09
418	002276	万马股份	27,600	161,184.00	0.09
419	603556	海兴电力	8,840	160,622.80	0.09
420	600026	中远海能	37,800	160,272.00	0.09



421	600058	五矿发展	19,000	157,890.00	0.09
422	603568	伟明环保	6,201	156,885.30	0.09
423	000990	诚志股份	11,200	156,800.00	0.09
424	000049	德赛电池	5,500	155,210.00	0.09
425	603888	新华网	9,201	155,128.86	0.09
426	002841	视源股份	2,900	154,889.00	0.09
427	603515	欧普照明	3,300	154,242.00	0.09
428	300134	大富科技	17,202	153,785.88	0.09
429	600757	长江传媒	26,900	153,061.00	0.09
430	600773	西藏城投	21,900	151,548.00	0.09
431	001696	宗申动力	30,700	150,430.00	0.09
432	002414	高德红外	11,100	149,184.00	0.09
433	002920	德赛西威	4,900	146,510.00	0.08
434	600006	东风汽车	35,400	144,786.00	0.08
435	603328	依顿电子	13,300	144,305.00	0.08
436	600657	信达地产	33,900	144,075.00	0.08
437	600640	号百控股	14,101	143,407.17	0.08
438	601127	小康股份	8,201	141,795.29	0.08
439	600639	浦东金桥	11,300	141,024.00	0.08
440	002344	海宁皮城	28,700	139,482.00	0.08
441	002190	成飞集成	8,000	136,720.00	0.08
442	002261	拓维信息	29,500	135,700.00	0.08
443	600458	时代新材	17,800	131,008.00	0.07
444	603056	德邦股份	4,700	128,733.00	0.07
445	300202	聚龙股份	12,300	128,289.00	0.07
446	300291	华录百纳	18,102	127,619.10	0.07
447	000806	银河生物	29,200	126,436.00	0.07
448	600748	上实发展	24,700	124,488.00	0.07
449	600350	山东高速	30,100	121,905.00	0.07
450	600651	飞乐音响	30,900	120,510.00	0.07
451	300032	金龙机电	21,400	120,054.00	0.07
452	600939	重庆建工	24,100	119,054.00	0.07
453	002807	江阴银行	21,100	118,582.00	0.07
454	002342	巨力索具	29,900	113,321.00	0.06
455	600184	光电股份	9,101	112,761.39	0.06
456	002479	富春环保	19,900	112,435.00	0.06
457	600517	置信电气	30,100	111,370.00	0.06
458	300043	星辉娱乐	27,600	110,400.00	0.06
459	603377	东方时尚	7,920	109,692.00	0.06

460	603355	莱克电气	3,601	108,210.05	0.06
461	600743	华远地产	41,900	107,683.00	0.06
462	603868	飞科电器	2,200	106,414.00	0.06
463	002041	登海种业	15,600	106,392.00	0.06
464	600126	杭钢股份	17,400	103,878.00	0.06
465	600996	贵广网络	13,900	103,138.00	0.06
466	600167	联美控股	10,300	103,000.00	0.06
467	600292	远达环保	17,400	102,138.00	0.06
468	600545	卓郎智能	12,800	101,632.00	0.06
469	600053	九鼎投资	5,800	99,586.00	0.06
470	603806	福斯特	4,480	98,604.80	0.06
471	601019	山东出版	12,200	97,722.00	0.06
472	603225	新凤鸣	4,880	97,453.60	0.06
473	002416	爱施德	16,481	96,743.47	0.06
474	601020	华钰矿业	7,001	96,543.79	0.06
475	601969	海南矿业	17,300	94,804.00	0.05
476	603169	兰石重装	18,800	94,188.00	0.05
477	000987	越秀金控	11,901	93,541.86	0.05
478	600618	氯碱化工	10,000	85,100.00	0.05
479	000761	本钢板材	20,200	81,608.00	0.05
480	000025	特力 A	2,400	77,208.00	0.04
481	000552	靖远煤电	21,600	70,632.00	0.04
482	002375	亚厦股份	13,100	69,954.00	0.04
483	601811	新华文轩	7,000	68,040.00	0.04
484	600971	恒源煤电	9,200	65,688.00	0.04
485	603025	大豪科技	3,200	61,888.00	0.04
486	002818	富森美	2,300	60,674.00	0.03
487	600917	重庆燃气	8,300	56,523.00	0.03
488	601777	力帆股份	9,900	51,777.00	0.03
489	603569	长久物流	3,520	50,265.60	0.03
490	002663	普邦股份	16,800	49,896.00	0.03
491	002588	史丹利	7,400	38,332.00	0.02
492	600428	中远海特	9,700	34,435.00	0.02
493	600862	中航高科	2,201	13,536.15	0.01
494	600481	双良节能	3,400	10,404.00	0.01

## 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000939	凯迪生态	91,100	368,044.00	0.21
2	300750	宁德时代	4,489	323,028.44	0.18
3	002005	德豪润达	54,600	238,056.00	0.14
4	601066	中信建投	18,690	201,104.40	0.11
5	000669	金鸿控股	21,841	158,347.25	0.09
6	600880	博瑞传播	36,000	153,360.00	0.09
7	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.07
8	601990	南京证券	10,230	110,995.50	0.06
9	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.05
10	300746	汉嘉设计	2,318	79,391.50	0.05
11	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.03
12	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.03
13	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600760	中航沈飞	707,190.48	0.31
2	002129	中环股份	688,426.00	0.31
3	002280	联络互动	643,081.00	0.28
4	002465	海格通信	633,351.00	0.28
5	600258	首旅酒店	609,056.80	0.27
6	600346	恒力股份	602,438.00	0.27
7	300315	掌趣科技	573,094.00	0.25
8	002815	崇达技术	569,245.00	0.25
9	000877	天山股份	552,651.00	0.24
10	000031	中粮地产	552,479.00	0.24
11	600528	中铁工业	551,227.00	0.24
12	000703	恒逸石化	541,666.80	0.24

13	300418	昆仑万维	534,581.00	0.24
14	000750	国海证券	516,910.00	0.23
15	002110	三钢闽光	499,950.00	0.22
16	002268	卫士通	463,683.00	0.21
17	601098	中南传媒	458,294.00	0.20
18	600536	中国软件	458,235.00	0.20
19	600895	张江高科	448,755.00	0.20
20	000686	东北证券	447,665.00	0.20

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600176	中国巨石	1,538,587.60	0.68
2	600516	方大炭素	1,524,969.00	0.68
3	002422	科伦药业	1,435,099.63	0.64
4	002405	四维图新	1,229,284.00	0.54
5	000786	北新建材	1,137,458.00	0.50
6	002271	东方雨虹	986,459.70	0.44
7	002001	新和成	936,393.40	0.41
8	002050	三花智控	919,863.00	0.41
9	000998	隆平高科	853,742.00	0.38
10	600438	通威股份	840,711.00	0.37
11	002032	苏泊尔	818,275.00	0.36
12	002311	海大集团	778,236.00	0.34
13	000981	银亿股份	752,949.00	0.33
14	000050	深天马 A	750,580.00	0.33
15	600566	济川药业	732,338.00	0.32
16	600346	恒力股份	711,559.00	0.32
17	002410	广联达	678,684.00	0.30
18	002280	联络互动	635,191.00	0.28
19	601699	潞安环能	619,869.00	0.27
20	000877	天山股份	619,022.00	0.27

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	80,084,763.40
卖出股票收入（成交）总额	104,817,146.91

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	12,680.20	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,680.20	0.01

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113508	新风转债	130	12,680.20	0.01

### 7.7 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。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1809	IC1809	4	4,090,080.00	-413,920.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-413,920.00
股指期货投资本期收益（元）					-154,520.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-435,920.00

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等，以降低交易成本和组合风险，提高投资效率。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内本基金投资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。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	932,948.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	17,937.46
5	应收申购款	1,605,837.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,556,723.48

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000939	凯迪生态	368,044.00	0.21	重大事项停牌
2	002005	德豪润达	238,056.00	0.14	重大资产重组停牌
3	000669	金鸿控股	158,347.25	0.09	重大资产重组停牌

## § 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇添富中证 500 指数(LOF) A	2,440	54,292.18	11,001,745.27	8.30%	121,471,165.84	91.70%
汇添富中证 500 指数(LOF) C	1,746	47,681.13	2,300,400.50	2.76%	80,950,857.82	97.24%
合计	4,186	51,534.68	13,302,145.77	6.17%	202,422,023.66	93.83%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证 500 指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	龚利红	1,252,740.00	5.06%
2	赵凤英	925,052.00	3.74%
3	周旭	733,088.00	2.96%
4	梁艳芬	547,832.00	2.21%
5	王曜蔚	508,013.00	2.05%
6	陈胜昔	498,299.00	2.01%
7	范福来	498,142.00	2.01%
8	林寿康	400,000.00	1.62%
9	黄伟颖	397,722.00	1.61%
10	蒋杜瑶	397,650.00	1.61%

汇添富中证 500 指数 (LOF) C

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
----	-------	----------	----------



1	刘世智	1,000,135.00	4.51%
2	杨锋	949,763.00	4.29%
3	魏华	750,033.00	3.38%
4	张效伟	700,085.00	3.16%
5	陈蔚	657,499.00	2.97%
6	曹霞玺	532,175.00	2.40%
7	吴淑燕	500,045.00	2.26%
8	王九红	434,829.00	1.96%
9	赖明华	375,022.00	1.69%
10	毛文广	320,699.00	1.45%

### 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	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	254,345.15	0.1920%
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	-	0.0000%
	合计	254,345.15	0.1179%

### 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	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	0
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	0
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0

**8.5 发起式基金发起资金持有份额情况**

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,700.27	4.64	10,002,700.27	4.64	3 年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	-	-	-
基金经理等人员	0.00	0.00	-	-	-
基金管理人股东	0.00	0.00	-	-	-
其他	254,345.15	0.12	-	-	-
合计	10,257,045.42	4.75	10,002,700.27	4.64	3 年

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2017 年 8 月 10 日) 基金份额总额	346,914,435.24	388,890,254.39
本报告期期初基金份额总额	156,313,569.85	81,031,013.59
本报告期基金总申购份额	28,377,450.96	57,655,507.06
减:本报告期基金总赎回份额	52,218,109.70	55,435,262.33
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	132,472,911.11	83,251,258.32

注：表内“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

## § 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。

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网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、基金财产的诉讼事项。

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	
招商证券	2	183,404,578.91	100.00%	168,808.10	100.00%	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	515,334.51	100.00%	-	-	-	-

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：

本基金本报告期内未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 年 1 月 2 日
2	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 增加浦发银行为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 1 月 16 日
3	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 增加中信期货为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 1 月 19 日
4	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 年 1 月 22 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加天天基金为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 2 月 1 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加好买基金为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 2 月 9 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加盈米财富为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 2 月 9 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加云湾投资为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 2 月 10 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加蛋卷基金为代销机构并参与费	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 2 月 10 日

	率优惠活动的公告		
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 2 月 10 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加肯特瑞财富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 年 3 月 9 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加恒天明泽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 年 3 月 19 日
13	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (2018 年第 1 号)	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 3 月 20 日
14	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 年 3 月 24 日
15	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 年 3 月 28 日
16	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 年 3 月 30 日
17	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加格上富信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 年 3 月 30 日
18	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加蚂蚁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 年 4 月 3 日
19	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 年 4 月 21 日
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加长量基金为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 5 月 9 日
21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 6 月 20 日
22	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加有	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 6 月 21 日



	鱼基金为代销机构并参与费率优惠活动的公告		
23	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 年 6 月 30 日

## § 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中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）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 8 月 25 日