

# 汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资 基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>18</b>
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	51
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	58
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</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.....	60

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金
基金简称	汇添富成长多因子量化策略股票
基金主代码	001050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 16 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,083,923,255.94 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在严格控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资于成长型行业的股票，采用基金管理人的金融工程团队开发的多因子量化策略进行选股。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×90% + 活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的基金产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105798
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105799
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 19-22 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	李文	易会满

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	-37,198,221.38
本期利润	-96,881,237.49
加权平均基金份额本期利润	-0.0865
本期加权平均净值利润率	-7.66%
本期基金份额净值增长率	-8.03%
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	-69,598,423.62
期末可供分配基金份额利润	-0.0642
期末基金资产净值	1,129,290,410.93
期末基金份额净值	1.042
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	4.20%

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

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

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

#### 3.2 基金净值表现

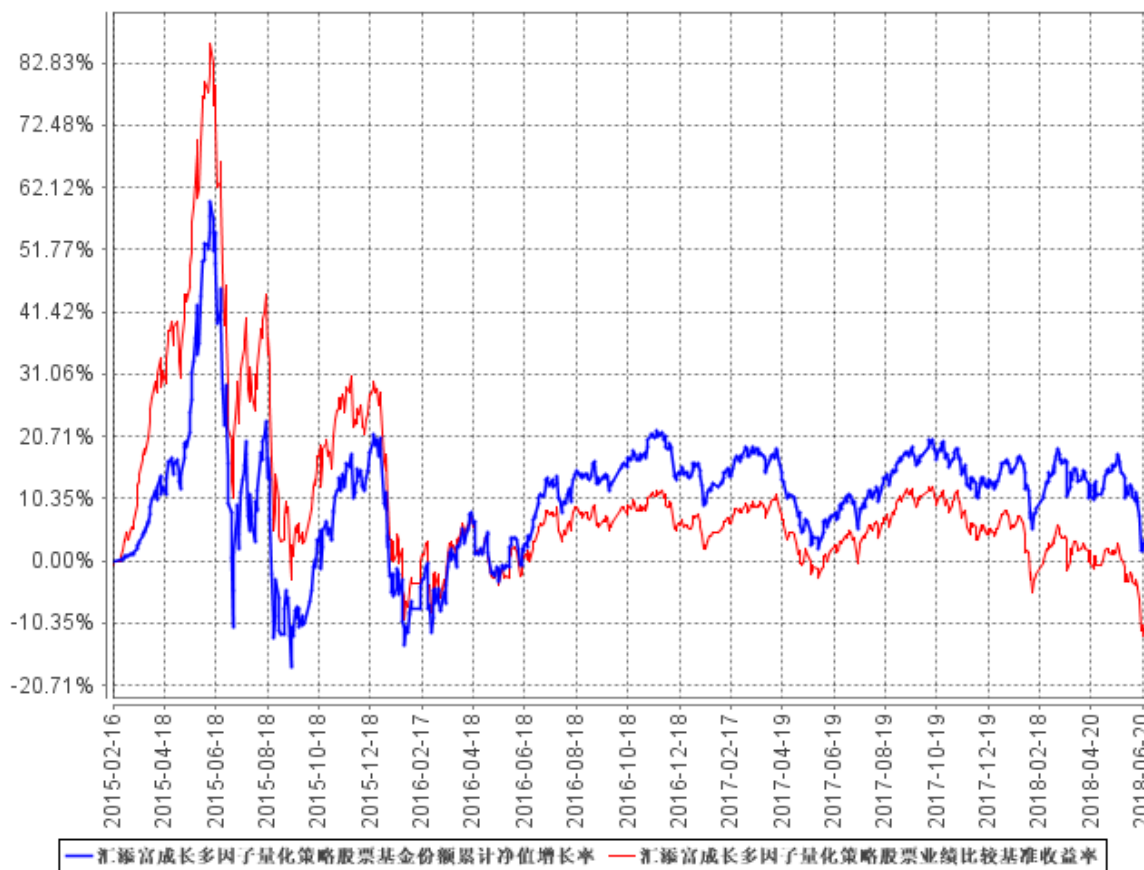
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-7.21%	1.69%	-8.40%	1.67%	1.19%	0.02%
过去三个月	-9.71%	1.31%	-13.25%	1.24%	3.54%	0.07%
过去六个月	-8.03%	1.27%	-14.89%	1.30%	6.86%	-0.03%
过去一年	-5.01%	1.08%	-13.43%	1.10%	8.42%	-0.02%
过去三年	-19.41%	1.93%	-37.37%	1.71%	17.96%	0.22%
自基金合同生效日起至 今	4.20%	1.95%	-9.11%	1.77%	13.31%	0.18%



### 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

汇添富成长多因子量化策略股票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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2015年2月16日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立，注册资本金为 132,724,224 元人民币。截止到 2018 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 4213.15 亿元，有效客户数约 1988 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 110 只开放式证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长混合型证券投资基金、汇添富成长焦点混合型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富民营活力混合型证券投资基金、汇添富香港优势混合型证券投资基金、汇添富医药保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、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、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富成长多因子量化策略股票基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务混合型证券投资基金、汇添富国企创新增长股票型证券投资基金、汇添富民营新动力股票型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富新兴消费股票型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富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。	2015 年 2 月 16 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。
许一尊	汇添富成长多因子股票基金、添	2015 年 11 月 24 日	-	8 年	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金

	富价值多因子股票基金的基金经理。			从业资格。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部高级分析师。2015 年 11 月 24 日至今任汇添富成长多因子量化策略股票基金的基金经理，2018 年 3 月 23 日至今任添富价值多因子股票基金的基金经理。
--	------------------	--	--	--

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人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；市场面因子角度，长期动量和短期反转效应均有体现，流动性、资金流向等因子也有一定的选股效果。

报告期内，本基金遵循量化基金投资的原则，相对业绩比较基准保持了均衡略偏成长的行业配置和风格配置。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内成长多因子基准下跌 14.89%，本基金在报告期内累计收益率为-8.03%，收益率超越业绩比较基准 6.86%。

## 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。

作为多因子量化基金，较均衡的风格和适合度的波动性有利超额收益的获取。汇添富成长多因子量化策略基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的量化投资策略，相对基准保持均衡偏成长的风格，追求相对业绩比较基准的较为稳定的超额收益。

#### 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：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 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，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。

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

无。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富成长多因子量化策略股票基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，汇添富成长多因子量化策略股票基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富成长多因子量化策略股票基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富成长多因子量化策略股票基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富成长多因子量化策略股票基金 2018 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	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	100,570,032.62	86,714,743.30
结算备付金		11,139,621.30	11,054,281.61
存出保证金		264,828.39	391,333.69
交易性金融资产	6.4.7.2	1,021,331,388.37	1,286,447,077.61
其中：股票投资		1,021,331,388.37	1,254,992,471.75
基金投资		-	-
债券投资		-	31,454,605.86
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	21,325.02	526,146.29
应收股利		-	-
应收申购款		1,227,649.38	294,007.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,134,554,845.08	1,385,427,589.66
<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		36,850.77	1,145.00
应付赎回款		289,550.07	1,017,413.77
应付管理人报酬		1,455,691.80	1,763,294.24
应付托管费		242,615.31	293,882.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,944,136.42	3,139,020.52

应交税费		2,152.14	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	293,437.64	360,108.46
负债合计		5,264,434.15	6,574,864.37
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,083,923,255.94	1,217,189,900.63
未分配利润	6.4.7.10	45,367,154.99	161,662,824.66
所有者权益合计		1,129,290,410.93	1,378,852,725.29
负债和所有者权益总计		1,134,554,845.08	1,385,427,589.66

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.042 元，基金份额总额 1,083,923,255.94 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-76,675,719.08	-42,505,878.65
1.利息收入		485,658.38	671,770.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	462,121.95	641,976.99
债券利息收入		13,015.88	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,520.55	29,793.65
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-17,712,218.17	-78,995,569.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-27,346,991.13	-88,383,240.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	75,507.27	-
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	63,844.66	193,240.00
股利收益	6.4.7.16	9,495,421.03	9,194,431.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-59,683,016.11	35,262,486.67
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	233,856.82	555,433.84

<b>减：二、费用</b>		20,205,518.41	22,974,628.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,381,632.48	12,705,680.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,563,605.41	2,117,613.46
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	9,057,035.19	7,963,346.35
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		234.64	-
7. 其他费用	6.4.7.20	203,010.69	187,988.30
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-96,881,237.49	-65,480,507.13

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,217,189,900.63	161,662,824.66	1,378,852,725.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-96,881,237.49	-96,881,237.49
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）	-133,266,644.69	-19,414,432.18	-152,681,076.87
其中：1. 基金申购款	146,754,359.03	21,152,205.87	167,906,564.90
2. 基金赎回款	-280,021,003.72	-40,566,638.05	-320,587,641.77
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）	1,083,923,255.94	45,367,154.99	1,129,290,410.93

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,541,175,536.73	217,901,068.22	1,759,076,604.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-65,480,507.13	-65,480,507.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-79,335,072.03	-9,906,487.13	-89,241,559.16
其中：1.基金申购款	232,255,648.67	30,110,994.72	262,366,643.39
2.基金赎回款	-311,590,720.70	-40,017,481.85	-351,608,202.55
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)	1,461,840,464.70	142,514,073.96	1,604,354,538.66

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

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
李骁

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
雷青松

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]117 号文《关于准予汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金注册的批复》的准予注册，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 2015 年 2 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 1,903,140,954.30 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和注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率 $\times$ 90%+活期存款利率（税后） $\times$ 10%。

#### 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 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	100,570,032.62
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：	100,570,032.62

### 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	1,123,192,832.57	1,021,331,388.37	-101,861,444.20
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	1,123,192,832.57	1,021,331,388.37	-101,861,444.20

### 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 2018年6月30日
应收活期存款利息	17,954.44
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	3,263.30
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	107.28
合计	21,325.02

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	2,944,136.42
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,944,136.42

**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	40.95
应付信息披露费	248,765.71
应付审计费	44,630.98
合计	293,437.64

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,217,189,900.63	1,217,189,900.63
本期申购	146,754,359.03	146,754,359.03
本期赎回(以“-”号填列)	-280,021,003.72	-280,021,003.72
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,083,923,255.94	1,083,923,255.94

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-37,417,064.69	199,079,889.35	161,662,824.66
本期利润	-37,198,221.38	-59,683,016.11	-96,881,237.49
本期基金份额交易产生的变动数	5,016,862.45	-24,431,294.63	-19,414,432.18
其中：基金申购款	-3,963,409.52	25,115,615.39	21,152,205.87
基金赎回款	8,980,271.97	-49,546,910.02	-40,566,638.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-69,598,423.62	114,965,578.61	45,367,154.99

### 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	400,784.24
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	58,038.14
其他	3,299.57
合计	462,121.95

注：表中“其他”为直销申购款和保证金利息收入。

### 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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	3,051,844,545.33
减：卖出股票成本总额	3,079,191,536.46
买卖股票差价收入	-27,346,991.13

### 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	75,507.27
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	75,507.27

#### 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	32,129,438.06

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	31,535,730.00
减：应收利息总额	518,200.79
买卖债券差价收入	75,507.27

#### 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	63,844.66

#### 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	9,495,421.03
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,495,421.03

#### 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	-59,683,016.11
——股票投资	-59,691,140.25
——债券投资	8,124.14
——资产支持证券投资	-
——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	-59,683,016.11

#### 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	233,856.82
合计	233,856.82

#### 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	9,056,810.19
银行间市场交易费用	225.00
合计	9,057,035.19

#### 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	44,630.98
信息披露费	148,765.71
账户维护费	9,000.00

银行划款费	614.00
合计	203,010.69

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的日后事项。

#### 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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 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		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东方证券股份有限公司	950,191,695.68	15.96%	1,897,026,434.12	36.13%

### 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		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东方证券股份有限	339,524.70	19.93%	-	-

注：本基金上年度可比期间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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
东方证券股份有	20,000,000.00	100.00%	70,000,000.00	90.91%

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 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
东方证券股份有 限公司	874,129.71	15.96%	508,231.35	17.26%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东方证券股份有 限公司	1,741,331.76	36.09%	453,886.34	19.72%

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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,381,632.48	12,705,680.37
其中：支付销售机构的客户维护费	3,234,224.96	4,588,285.98

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，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 2 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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,563,605.41	2,117,613.46

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，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 2 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、公休假等，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自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 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及上年度末均未投资本基金。

#### 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		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	100,570,032.62	400,784.24	146,128,057.89	571,384.48

#### 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：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

## 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	备注
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	621,880	11,080,027.97	11,038,370.00	-
600745	闻泰科技	2018年4月17日	重大资产重组停牌	30.48	-	-	198,900	5,930,593.11	6,062,472.00	-
000415	渤海金控	2018年1月17日	重大资产重组停牌	5.84	2018年7月17日	5.26	870,100	5,026,488.97	5,081,384.00	-
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	1,518,000	3,338,066.93	3,066,360.00	-
600759	洲际油气	2018年3月27日	重大资产重组	3.94	-	-	639,900	2,268,163.50	2,521,206.00	-

			组 停 牌							
300266	兴 源 环 境	2018 年 2 月 5 日	重 大 资 产 重 组 停 牌	16.67	2018 年 7 月 2 日	17.99	93,600	2,574,556.00	1,560,312.00	-

### 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

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。

#### 6.4.13.1 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、结算备付金、存出保证金、债券投资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	100,570,032.62	-	-	-	-	-	100,570,032.62
结算备付金	11,139,621.30	-	-	-	-	-	11,139,621.30
存出保证金	264,828.39	-	-	-	-	-	264,828.39
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,021,331,388.37	1,021,331,388.37
应收利息	-	-	-	-	-	21,325.02	21,325.02
应收申购款	137,854.09	-	-	-	-	1,089,795.29	1,227,649.38
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	112,112,336.40	-	-	-	-	1,022,442,508.68	1,134,554,845.08
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	36,850.77	36,850.77
应付赎回款	-	-	-	-	-	289,550.07	289,550.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,455,691.80	1,455,691.80
应付托管费	-	-	-	-	-	242,615.31	242,615.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,944,136.42	2,944,136.42
应交税费	-	-	-	-	-	2,152.14	2,152.14
其他负债	-	-	-	-	-	293,437.64	293,437.64
负债总计	-	-	-	-	-	5,264,434.15	5,264,434.15
利率敏感度缺	112,112,336.40	-	-	-	-	1,017,178,074.53	1,129,290,410.93

口							
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	86,714,743.30	-	-	-	-	-	86,714,743.30
结算备付金	11,054,281.61	-	-	-	-	-	11,054,281.61
存出保证金	391,333.69	-	-	-	-	-	391,333.69
交易性金融资 产	-	-	31,454,605.86	-	-	1,254,992,471.75	1,286,447,077.61
应收利息	-	-	-	-	-	526,146.29	526,146.29
应收申购款	113,679.45	-	-	-	-	180,327.71	294,007.16
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	98,274,038.05	-	31,454,605.86	-	-	1,255,698,945.75	1,385,427,589.66
负债							
应付证券清算 款	-	-	-	-	-	1,145.00	1,145.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,017,413.77	1,017,413.77
应付管理人报 酬	-	-	-	-	-	1,763,294.24	1,763,294.24
应付托管费	-	-	-	-	-	293,882.38	293,882.38
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,139,020.52	3,139,020.52
其他负债	-	-	-	-	-	360,108.46	360,108.46
负债总计	-	-	-	-	-	6,574,864.37	6,574,864.37
利率敏感度缺 口	98,274,038.05	-	31,454,605.86	-	-	1,249,124,081.38	1,378,852,725.29

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	4. 银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；		
	5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	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 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	基准利率增加 25 个基点	-	-39,616.84

基准利率减少 25 个基点	-	39,717.50
---------------	---	-----------

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的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 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,021,331,388.37	90.44	1,254,992,471.75	91.02
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	31,454,605.86	2.28
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	1,021,331,388.37	90.44	1,286,447,077.61	93.30

注：本基金股票资产不低于基金资产的 80%，其中投资于成长型行业的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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表所示。

##### 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，即从长期来看，本基
----	---------------------------------------



	金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	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。		
分析	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6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	中证500指数上涨5%	48,833,439.41	61,980,588.42
	中证500指数下跌5%	-48,833,439.41	-61,980,588.42

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 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	1,021,331,388.37	90.02
	其中：股票	1,021,331,388.37	90.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	111,709,653.92	9.85
8	其他各项资产	1,513,802.79	0.13
9	合计	1,134,554,845.08	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	4,155,204.00	0.37
B	采矿业	28,632,797.00	2.54
C	制造业	695,036,861.11	61.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,254,446.21	1.35
E	建筑业	10,661,702.18	0.94

F	批发和零售业	40,536,019.84	3.59
G	交通运输、仓储和邮政业	25,742,256.00	2.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,373,970.12	4.02
J	金融业	10,420,130.90	0.92
K	房地产业	62,178,173.40	5.51
L	租赁和商务服务业	28,695,144.47	2.54
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,900,208.14	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,208,701.00	0.99
R	文化、体育和娱乐业	29,697,326.00	2.63
S	综合	7,838,448.00	0.69
	合计	1,021,331,388.37	90.44

### 7.2.2 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

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	600486	扬农化工	385,600	21,566,608.00	1.91
2	000876	新希望	3,179,500	20,158,030.00	1.79
3	601888	中国国旅	308,539	19,872,996.99	1.76
4	002294	信立泰	523,900	19,473,363.00	1.72
5	002008	大族激光	352,200	18,733,518.00	1.66
6	600183	生益科技	1,989,115	18,220,293.40	1.61
7	600436	片仔癀	162,100	18,143,853.00	1.61
8	002373	千方科技	1,353,700	17,665,785.00	1.56
9	600201	生物股份	975,806	16,676,524.54	1.48
10	002233	塔牌集团	1,444,100	16,520,504.00	1.46
11	000778	新兴铸管	3,786,200	16,204,936.00	1.43
12	000895	双汇发展	584,900	15,447,209.00	1.37
13	603288	海天味业	202,200	14,890,008.00	1.32
14	600153	建发股份	1,597,500	14,361,525.00	1.27

15	600064	南京高科	1,947,600	14,295,384.00	1.27
16	600256	广汇能源	3,431,700	14,035,653.00	1.24
17	603799	华友钴业	143,400	13,977,198.00	1.24
18	600563	法拉电子	275,000	13,609,750.00	1.21
19	002597	金禾实业	665,400	13,494,312.00	1.19
20	600216	浙江医药	1,046,400	13,362,528.00	1.18
21	600694	大商股份	402,984	13,101,009.84	1.16
22	000031	中粮地产	2,242,100	12,959,338.00	1.15
23	002626	金达威	742,729	12,886,348.15	1.14
24	300251	光线传媒	1,255,400	12,779,972.00	1.13
25	300527	中国应急	1,252,700	12,602,162.00	1.12
26	000718	苏宁环球	3,387,500	12,432,125.00	1.10
27	002242	九阳股份	679,200	12,015,048.00	1.06
28	601126	四方股份	2,230,000	11,350,700.00	1.01
29	600763	通策医疗	230,300	11,208,701.00	0.99
30	300182	捷成股份	1,463,100	11,090,298.00	0.98
31	600750	江中药业	621,880	11,038,370.00	0.98
32	300618	寒锐钴业	83,980	10,777,993.20	0.95
33	002518	科士达	1,071,475	10,682,605.75	0.95
34	601107	四川成渝	3,086,600	10,587,038.00	0.94
35	600742	一汽富维	842,160	10,299,616.80	0.91
36	300122	智飞生物	223,800	10,236,612.00	0.91
37	600765	中航重机	1,325,200	9,859,488.00	0.87
38	300601	康泰生物	156,644	9,719,760.20	0.86
39	300398	飞凯材料	487,000	9,525,720.00	0.84
40	600622	光大嘉宝	1,321,840	9,504,029.60	0.84
41	002685	华东重机	1,142,900	9,406,067.00	0.83
42	600779	水井坊	166,256	9,182,318.88	0.81
43	600426	华鲁恒升	516,200	9,079,958.00	0.80
44	300055	万邦达	750,082	8,618,442.18	0.76
45	603025	大豪科技	434,838	8,409,766.92	0.74
46	600525	长园集团	768,900	8,127,273.00	0.72
47	601788	光大证券	732,200	8,039,556.00	0.71
48	600777	新潮能源	3,579,200	7,838,448.00	0.69
49	002815	崇达技术	481,000	7,744,100.00	0.69
50	600668	尖峰集团	625,900	7,635,980.00	0.68
51	600056	中国医药	407,800	7,450,506.00	0.66
52	000662	天夏智慧	1,153,684	7,418,188.12	0.66
53	002406	远东传动	1,310,000	7,191,900.00	0.64

54	600987	航民股份	750,700	7,094,115.00	0.63
55	002223	鱼跃医疗	358,600	6,989,114.00	0.62
56	002056	横店东磁	988,200	6,927,282.00	0.61
57	600708	光明地产	1,600,420	6,881,806.00	0.61
58	000758	中色股份	1,517,300	6,827,850.00	0.60
59	002677	浙江美大	392,300	6,826,020.00	0.60
60	600006	东风汽车	1,600,100	6,544,409.00	0.58
61	000685	中山公用	816,688	6,509,003.36	0.58
62	002268	卫士通	296,800	6,479,144.00	0.57
63	002258	利尔化学	330,000	6,388,800.00	0.57
64	300447	全信股份	493,400	6,384,596.00	0.57
65	600446	金证股份	578,400	6,368,184.00	0.56
66	600859	王府井	296,200	6,300,174.00	0.56
67	600745	闻泰科技	198,900	6,062,472.00	0.54
68	601012	隆基股份	362,120	6,043,782.80	0.54
69	300026	红日药业	1,648,100	6,015,565.00	0.53
70	000828	东莞控股	734,700	5,862,906.00	0.52
71	002001	新和成	307,580	5,831,716.80	0.52
72	600664	哈药股份	1,426,600	5,663,602.00	0.50
73	002152	广电运通	961,100	5,651,268.00	0.50
74	300409	道氏技术	136,100	5,458,971.00	0.48
75	600887	伊利股份	192,700	5,376,330.00	0.48
76	601717	郑煤机	915,400	5,318,474.00	0.47
77	300097	智云股份	297,200	5,266,384.00	0.47
78	000415	渤海金控	870,100	5,081,384.00	0.45
79	601968	宝钢包装	1,312,400	5,065,864.00	0.45
80	600775	南京熊猫	894,500	5,062,870.00	0.45
81	601599	鹿港文化	1,237,200	5,035,404.00	0.45
82	002535	林州重机	1,336,300	5,024,488.00	0.44
83	002221	东华能源	485,300	4,741,381.00	0.42
84	600104	上汽集团	132,300	4,629,177.00	0.41
85	002579	中京电子	515,500	4,562,175.00	0.40
86	002376	新北洋	275,500	4,556,770.00	0.40
87	000425	徐工机械	1,070,600	4,539,344.00	0.40
88	000898	鞍钢股份	802,900	4,472,153.00	0.40
89	300529	健帆生物	104,200	4,469,138.00	0.40
90	600366	宁波韵升	709,400	4,327,340.00	0.38
91	000651	格力电器	91,600	4,318,940.00	0.38
92	300388	国祯环保	221,000	4,258,670.00	0.38

93	002393	力生制药	172,000	4,210,560.00	0.37
94	601000	唐山港	1,770,200	4,159,970.00	0.37
95	000592	平潭发展	1,463,100	4,155,204.00	0.37
96	603806	福斯特	186,700	4,109,267.00	0.36
97	000631	顺发恒业	1,191,200	4,085,816.00	0.36
98	002449	国星光电	375,400	3,994,256.00	0.35
99	300027	华谊兄弟	648,300	3,993,528.00	0.35
100	000951	中国重汽	294,355	3,911,977.95	0.35
101	300100	双林股份	352,300	3,857,685.00	0.34
102	601238	广汽集团	342,800	3,818,792.00	0.34
103	600057	厦门象屿	749,652	3,740,763.48	0.33
104	300219	鸿利智汇	377,300	3,652,264.00	0.32
105	603556	海兴电力	188,130	3,418,322.10	0.30
106	601137	博威合金	415,100	3,354,008.00	0.30
107	300287	飞利信	447,000	3,213,930.00	0.28
108	002245	澳洋顺昌	493,600	3,193,592.00	0.28
109	603225	新凤鸣	157,900	3,153,263.00	0.28
110	002095	生意宝	87,000	3,122,430.00	0.28
111	600022	山东钢铁	1,518,000	3,066,360.00	0.27
112	601168	西部矿业	481,100	3,021,308.00	0.27
113	300034	钢研高纳	318,200	2,978,352.00	0.26
114	002247	帝龙文化	362,000	2,968,400.00	0.26
115	000601	韶能股份	673,100	2,954,909.00	0.26
116	000690	宝新能源	411,200	2,861,952.00	0.25
117	000598	兴蓉环境	703,700	2,857,022.00	0.25
118	300292	吴通控股	745,300	2,727,798.00	0.24
119	600592	龙溪股份	424,800	2,612,520.00	0.23
120	600759	洲际油气	639,900	2,521,206.00	0.22
121	603111	康尼机电	355,700	2,351,177.00	0.21
122	002413	雷科防务	414,800	2,235,772.00	0.20
123	600508	上海能源	208,500	2,226,780.00	0.20
124	300316	晶盛机电	164,500	2,186,205.00	0.19
125	603660	苏州科达	93,380	2,115,057.00	0.19
126	000547	航天发展	267,400	2,088,394.00	0.18
127	601566	九牧王	141,000	2,079,750.00	0.18
128	000848	承德露露	196,200	2,077,758.00	0.18
129	600390	五矿资本	266,900	2,068,475.00	0.18
130	600438	通威股份	298,300	2,058,270.00	0.18
131	601789	宁波建工	566,000	2,043,260.00	0.18

132	600382	广东明珠	192,600	2,031,930.00	0.18
133	000965	天保基建	456,940	2,019,674.80	0.18
134	300039	上海凯宝	345,200	2,002,160.00	0.18
135	300257	开山股份	129,800	1,984,642.00	0.18
136	600106	重庆路桥	646,250	1,938,750.00	0.17
137	002124	天邦股份	434,300	1,876,176.00	0.17
138	000156	华数传媒	190,200	1,833,528.00	0.16
139	002231	奥维通信	276,700	1,610,394.00	0.14
140	300266	兴源环境	93,600	1,560,312.00	0.14
141	002401	中远海科	110,300	1,106,309.00	0.10
142	002038	双鹭药业	27,700	1,052,323.00	0.09
143	603058	永吉股份	81,800	930,884.00	0.08
144	300750	宁德时代	10,261	738,381.56	0.07
145	601066	中信建投	18,690	201,104.40	0.02
146	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.01
147	601990	南京证券	10,230	110,995.50	0.01
148	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.01
149	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
150	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
151	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
152	300745	欣锐科技	204	16,744.32	0.00
153	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00

## 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	601012	隆基股份	35,498,347.71	2.57
2	002044	美年健康	35,101,370.55	2.55
3	300122	智飞生物	33,481,964.29	2.43
4	002635	安洁科技	29,261,360.59	2.12
5	000876	新希望	25,004,310.73	1.81
6	000069	华侨城 A	24,208,134.05	1.76
7	601888	中国国旅	24,081,331.18	1.75
8	300182	捷成股份	23,617,966.30	1.71
9	002001	新和成	23,148,445.53	1.68

10	002294	信立泰	22,501,259.70	1.63
11	000778	新兴铸管	21,435,750.65	1.55
12	600346	恒力股份	21,153,681.42	1.53
13	000413	东旭光电	21,082,079.20	1.53
14	600486	扬农化工	20,783,717.19	1.51
15	002714	牧原股份	20,010,374.97	1.45
16	300065	海兰信	19,964,156.17	1.45
17	600153	建发股份	19,515,273.60	1.42
18	601857	中国石油	19,429,427.97	1.41
19	002373	千方科技	19,109,835.46	1.39
20	601991	大唐发电	19,099,852.98	1.39

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002044	美年健康	38,671,862.05	2.80
2	601012	隆基股份	37,244,911.50	2.70
3	002635	安洁科技	32,229,226.43	2.34
4	300122	智飞生物	30,700,865.29	2.23
5	000651	格力电器	29,932,386.38	2.17
6	600519	贵州茅台	29,345,194.55	2.13
7	601318	中国平安	28,325,394.06	2.05
8	002415	海康威视	28,123,307.01	2.04
9	603658	安图生物	27,197,298.70	1.97
10	000333	美的集团	26,773,336.05	1.94
11	600390	五矿资本	23,931,658.66	1.74
12	002456	欧菲科技	23,659,696.95	1.72
13	300072	三聚环保	23,520,886.78	1.71
14	002310	东方园林	22,854,415.72	1.66
15	600260	凯乐科技	22,697,032.49	1.65
16	600346	恒力股份	22,296,595.43	1.62
17	000069	华侨城 A	22,140,930.42	1.61
18	600297	广汇汽车	21,787,503.70	1.58
19	603660	苏州科达	21,434,360.75	1.55



20	601857	中国石油	20,953,891.79	1.52
----	--------	------	---------------	------

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	2,905,221,593.33
卖出股票收入（成交）总额	3,051,844,545.33

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

### 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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

## 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	264,828.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,325.02
5	应收申购款	1,227,649.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,513,802.79

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
49,266	22,001.45	100,027,180.32	9.23%	983,896,075.62	90.77%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	471,480.90	0.0435%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年2月16日）基金份额总额	1,903,140,954.30
本报告期期初基金份额总额	1,217,189,900.63
本报告期基金总申购份额	146,754,359.03
减：本报告期基金总赎回份额	280,021,003.72
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	1,083,923,255.94

注：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	
东方证券	2	950,191,695.68	15.96%	874,129.71	15.96%	-
兴业证券	2	898,173,945.04	15.08%	821,548.97	15.00%	-
西南证券	1	618,500,514.64	10.39%	563,641.06	10.29%	-
中信建投	1	527,981,840.14	8.87%	491,713.72	8.98%	-
中泰证券	2	507,611,211.48	8.52%	463,469.71	8.46%	-
安信证券	2	383,939,845.85	6.45%	350,602.63	6.40%	-
东兴证券	1	327,883,552.72	5.51%	305,356.27	5.58%	-
东吴证券	2	238,168,983.91	4.00%	218,550.34	3.99%	-
华泰联合证券	1	223,450,711.89	3.75%	203,631.45	3.72%	-
国信证券	2	179,759,374.33	3.02%	163,816.03	2.99%	-
光大证券	1	172,227,686.05	2.89%	160,394.58	2.93%	-
长江证券	1	134,691,724.91	2.26%	125,439.69	2.29%	-
高华证券	1	117,516,996.64	1.97%	109,445.16	2.00%	-
招商证券	2	108,546,792.78	1.82%	98,918.80	1.81%	-
广发证券	1	101,091,985.02	1.70%	94,146.80	1.72%	-
长城证券	1	92,927,023.20	1.56%	86,542.82	1.58%	-
申万宏源证券	1	88,473,731.73	1.49%	82,394.09	1.50%	-
中银国际	1	84,807,343.03	1.42%	78,981.12	1.44%	-
中投证券	1	59,499,101.20	1.00%	55,411.66	1.01%	-
银河证券	2	43,689,391.26	0.73%	39,814.32	0.73%	-
华鑫证券	1	42,168,326.56	0.71%	39,270.60	0.72%	-
华泰证券	1	36,913,042.76	0.62%	34,376.82	0.63%	-
国金证券	2	16,397,262.08	0.28%	14,942.81	0.27%	-

渤海证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	339,524.70	19.93%	20,000,000.00	100.00%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券	823,036.32	48.32%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	540,763.20	31.75%	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-



广发证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加农业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 1 月 12 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加南洋商业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 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	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
6	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
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通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
8	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
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加途牛金服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 31 日
10	汇添富成长多因子量化策略股票	中证报, 证券时报,	2018 年 3 月 31 日

	型证券投资基金更新招募说明书 (2018 年第 1 号)	上证报, 公司网站	
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 年 4 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参加南洋商业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 4 月 19 日
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 年 4 月 21 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加凯石财富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 4 月 23 日
15	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 年 5 月 16 日
16	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
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 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成长多因子量化策略股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富成长多因子量化策略股票型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、报告期内汇添富成长多因子量化策略股票型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 层 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