

汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 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：2019 年 03 月 26 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 22 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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	17
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49

8.3 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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
8.6 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	60
8.7 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	60
8.8 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	60
8.9 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	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 投资组合报告附注	61
§ 9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	62
§ 10 开放式基金份额变动	62
§ 11 重大事件揭示	62
11.1 基金份额持有人大会决议	62
11.2 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	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	70
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	72
12.1 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	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	74
13.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金
基金简称	汇添富沪深 300 安中指数
基金主代码	000368
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 6 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	221,135,626.32 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪沪深 300 安中动态策略指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。
投资策略	主要采取完全复制法。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	沪深 300 安中动态策略指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型指数基金，在证券投资基金中属于较高预期风险、较高预期收益的品种，本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798
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 20 楼	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网	www.99fund.com

址	
基金年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
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 20 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-37,208,786.17	48,412,442.14	-23,511,617.21
本期利润	-89,716,760.75	68,405,474.57	-24,083,107.96
加权平均基金份额本期利润	-0.4096	0.3034	-0.1197
本期加权平均净值利润率	-28.22%	20.50%	-9.57%
本期基金份额净值增长率	-25.44%	23.44%	-8.39%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	45,851,448.45	115,993,330.63	57,054,884.68
期末可供分配基金份额利润	0.2073	0.4841	0.2727
期末基金资产净值	266,987,074.77	387,970,018.18	274,424,958.61
期末基金份额净值	1.2073	1.6193	1.3118
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额	20.73%	61.93%	31.18%

累计净值 增长率			
-------------	--	--	--

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。

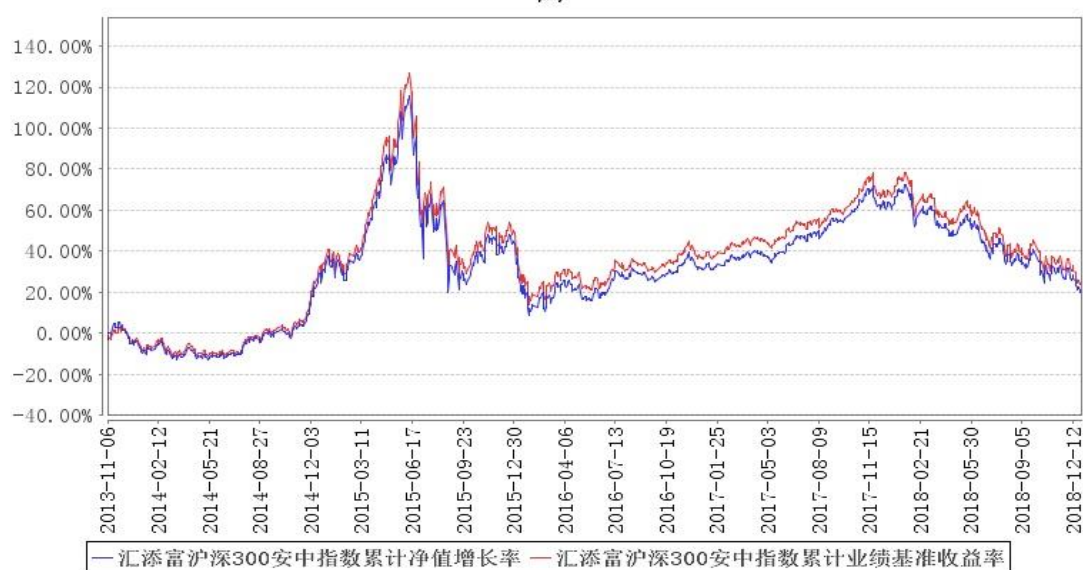
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-14.08%	1.55%	-14.23%	1.56%	0.15%	-0.01%
过去六个月	-15.54%	1.39%	-16.26%	1.40%	0.72%	-0.01%
过去一年	-25.44%	1.27%	-25.27%	1.27%	-0.17%	0.00%
过去三年	-15.69%	1.17%	-16.01%	1.15%	0.32%	0.02%
过去五年	25.79%	1.55%	28.31%	1.50%	-2.52%	0.05%
自基金合同生效起至今	20.73%	1.54%	24.24%	1.49%	-3.51%	0.05%

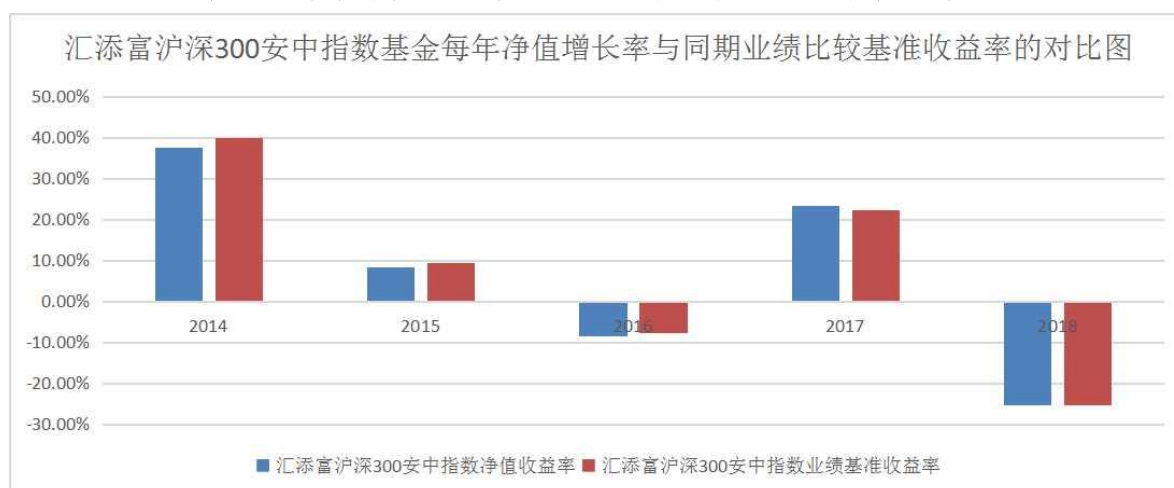
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富沪深300安中指数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:本基金建仓期为自《基金合同》生效之日(2013年11月6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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金的《基金合同》生效日为2013年11月6日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金2016年度、2017年度和2018年度均未进行利润分配。

§ 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

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

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

目前，汇添富基金已经发展成为长期业绩优异、产品布局完善、业务领域全面、资产管理规模居前的大型基金公司。截至 2018 年 12 月 31 日，汇添富资产管理总规模超过 6500 亿元，其中公募资产管理规模（剔除货基及短期理财债基）为 1738.78 亿元，稳居行业前十。优秀的产品及服务赢得了行业与市场的高度认可。2018 年，汇添富基金荣获“十大产品创新基金公司奖”“公募基金 20 年最佳主动权益基金管理人”“公募基金 20 年十大最佳基金管理人”“基金 20 年‘金基金’TOP 基金公司”“中国基金业 20 周年优秀基金管理公司（7-15 年组别）及管理层”等奖项，旗下多只基金荣获金牛奖、金基金奖、明星基金奖等奖项；“添富智投”荣获“上海金融创新奖”，“添富养老”荣获“综合奖·2018 中国 AI 金融先锋榜”等奖项。

2018 年，汇添富基金新成立 23 只公募基金，包括 13 只混合型基金，2 只股票型基金，2 只指数基金，6 只债券基金。新发重点主动权益产品包括添富价值创造定开混合、添富行业整合混合、添富智能制造股票、汇添富文体娱乐混合、添富创新医药混合、添富全球消费混合（QDII）等，有序推动不同久期、信用级别的债券产品落地，参与发售战略配售基金，探索养老目标日期 FOF 基金。2018 年底，公司公募基金产品总数达 120 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2018 年，汇添富基金进一步夯实自有平台基础建设，在全方位升级平台架构及安全系统的基础上，不断引领行业创新，规模及客户数均处于行业领先水平。全年实现指纹识别、人脸识别、常用设备保护、7*24 小时智能交易监控等重大升级；推出多款树立行业标杆的拳头功能：指数宝、理财日历、模拟组合、实时估值等。与此同时，互联网金融对外合作业务取得重大突破，与多家

互联网巨头达成深度战略合作。截至年底，对外合作伙伴数量已超 110 家，成为业内对外合作最多的公司之一。

2018 年，汇添富基金持续推进大机构战略，机构业务规模保持较好的增长势头。公司深受专业机构投资者信任，获得所有大型银行及保险委外专户组合，且保险委托管理规模同业排名第一。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务规模快速增长，受托管理组合账户数量及规模持续增加。

2018 年，公司积极开展渠道销售和培训工作，专业的投顾服务以及良好的渠道维护口碑不断提升汇添富品牌在渠道影响力和认可度。同时公司持续大力开展定投、投资者教育、添富论坛等系列客户活动，营销培训活动拓展到银行和券商的网点、营业部。

2018 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，全方位优化客户服务体系。公司通过完善大客户平台建设，搭建了囊括投顾式服务、基金理财、高端客户、现金宝的全新客服体系，为公司各项销售业务提供全方位支持。同时，持续优化电话、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提高客服体验。

2018 年，香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理继续发挥显著成效，国际业务总资产管理规模取得长足进步。公司海外产品线进一步完善，发行了 QDII 项下汇添富全球消费行业混合型证券投资基金；港股通项下添富沪港深大盘价值混合基金、添富沪港深优势定开基金。“港股通”类委外专户管理规模继续保持领先，海外主动管理权益资产规模保持行业前列。2018 年，香港子公司在加强母公司投研一体化基础上，港股投资及海外债券投资业绩持续优异，汇添富中港策略基金获得晨星三年与五年的五星评级，根据彭博统计在最近三年、五年同类港股基金中业绩均位列第一；汇添富港币债券基金获得晨星三年和五年四星评级。

2018 年，汇添富公益事业坚持不懈，连续第十一年开展“河流·孩子”公益助学计划。继 2017 年公司党委下属的八个党支部和各地“添富小学”建立结对关系后，2018 年，各支部纷纷前往相应学校开展回访及支教活动。党员们经过实地探访，了解学校实际困难和发展需求，邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的“添富小学”参加公益服务，并通过向公司员工发售筹款台历、参加“99 公益日”筹款、参与“一个鸡蛋的暴走”等活动，全年筹款约 8 万余元，用于添富小学国学课程筹备及开设、教师培训项目开展、图书室扩充等。

2019 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

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。	2013 年 11 月 6 日	-	12	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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定了《汇

添富基金管理有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究环节，公司建立了统一的投研平台信息管理系统，公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时，通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。（2）在投资环节，公司针对基金、专户、社保、境外投资分别设立了投资决策委员会，各委员会根据各自议事规则分别召开会议，在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略，独立制定资产配置计划和组合调整方案，并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。（3）在交易环节，公司实行集中交易，所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式，按照“时间优先、价格优先、比例分配”的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理，严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配，确保交易的公平性。（4）在交易监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析方面，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。同时，投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

4.3.2 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。报告期内，本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度，进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、清算，以及稽核监察等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3 日、5 日）同向交易的样本，根据 95%置信区间下差价率的 T 检验显著程度、差价率均值是否小于 1%、同向交易占优比等方面进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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 13 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，基本面角度，宏观经济保持韧性，但经济增长及企业盈利在边际上存在一定压力；政策面，去杠杆和金融强监管保持定力，有效降低了系统性风险，同时政策灵活性提高，下半年逆周期调控措施逐步出台，扶持民营企业、鼓励金融支持实体经济、进一步扩大改革开放、推进减税减费等一系列举措，边际上改善市场的风险偏好；中美经贸争端呈现长期性和复杂性，影响逐渐显现，成为市场的重要外生变量。

风格上，A 股进一步向成熟市场靠拢，基本面质地优良的股票存在较持续的超额收益，与此同时，盈利能力一般的部分中小市值股票流动性持续萎缩。相比 2017 年极致化的“二八分化”，2018 年不同风格、行业、个股的表现相对更加均衡，但部分事件对特定行业和个股的影响极大，如医药、“贸易战”相关板块和个股出现了较大的波动，风格和行业均衡配置的重要性继续加大。

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 92%~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

报告期内安中沪深 300 指数基准为-25.27%，本基金在报告期内累计收益率为-25.44%，收益率落后业绩比较基准 0.17%。收益率的差异因素主要来源于期间成份股分红、日常申购赎回等因素。

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 2019 年，经济基本面角度，国内经济增速下行压力仍然存在，货币、信用已趋于边际宽松，随着逆周期调节措施的加码，总体经济形势或将趋于平稳。政策方面，当前去杠杆、强监管、控风险措施初见成效，进一步深化改革开放，加大减税降费力度，激发企业活力等一系列改革措施可能成为经济发展的重要驱动力，从而边际上改善市场的风险偏好；中美博弈具有长期性和复杂性，随着美国自身经济形势和国内外环境的变化，可能出现一定进展，从而带来相对稳定的外

部环境。

估值角度，当前 A 股处于历史低位，相比国外资本市场同样具有一定的吸引力，已经进入可以逐步配置的区间。资金面角度，随着资本市场进一步对外开放，海外资金大概率仍将持续流入 A 股；养老金、社保、保险等长期资金存在权益资产配置需求，A 股有进一步向成熟市场靠拢的可能性。风格角度，从基本面和增量资金偏好角度，质地优良、估值匹配度高的股票仍具有核心配置价值；行业角度，改革深化、减税降费、中美贸易争端均可能对一些行业的竞争格局产生影响，站在风控角度，保持风格和行业均衡的重要性进一步提高。

汇添富沪深 300 安中动态策略基金投资标的以大盘蓝筹标的为主，大概率受益于 A 股投资者结构变化趋势，同时风格行业相对均衡，是在市场底部区域逐步配置的良好标的。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司以维护基金份额持有人利益为宗旨，有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则，认真履行职责，通过合规法务、投资风控、稽核内审工作，加强公司经营与基金运作的合规性监察，促进内部控制和风险管理的不断改进，并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

1、进一步提升合规法务管理工作

强化合规审核和风险把控，在业务日常推进中加强合规管理；为公司各项业务的进展和风险控制提供全面的法务数据和法律支持；强化对合规专职、兼职人员履职情况的日常管理，有效实现合规管理的下沉；开展形式多样的合规培训与教育，促进人员合规执业。

2、进一步完善投资风险控制工作

加强投资风险排查，推动公司内部风险评价体系建设；通过持续的系统建设以及人员专业能力提升，将风险管理工作向一线业务进一步下沉；有效实施投资交易监控，推动风险管理系统的优化及完善。

3、进一步加强稽核内审工作

通过日常风险排查与专项稽核，协助公司各业务条线尽早发现并控制合规风险；采取稽核监察措施，监督人员合规执业；通过协助监管机构检查工作和会计事务所审计工作，促进公司不断完善内部控制管理。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和

运用基金资产，继续加强合规管理和风险控制，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

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

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 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。

本基金本报告期末进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的投资运作、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，汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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和披露的汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金 2018 年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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2019）审字第 60466941_B40 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表, 2018 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为, 后附的汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规

	定编制，公允反映了汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，

	未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	徐 艳	许培菁
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2019 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	14,921,853.47	26,139,279.40
结算备付金		672,584.11	923,067.48
存出保证金		29,846.61	55,052.21
交易性金融资产	7.4.7.2	251,972,695.04	368,537,170.22
其中：股票投资		251,940,695.04	368,348,270.22
基金投资		—	—
债券投资		32,000.00	188,900.00
资产支持证券投资		—	—

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		26,378,887.02	24,088,712.57
应收利息	7.4.7.5	3,212.50	5,499.67
应收股利		-	-
应收申购款		302,566.43	67,579.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		294,281,645.18	419,816,360.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		26,399,500.29	30,441,765.69
应付赎回款		3,249.61	242,414.03
应付管理人报酬		116,634.62	165,167.60
应付托管费		23,326.91	33,033.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	321,852.77	573,082.77
应交税费		0.01	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	430,006.20	390,879.11
负债合计		27,294,570.41	31,846,342.71
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	221,135,626.32	239,592,806.85
未分配利润	7.4.7.10	45,851,448.45	148,377,211.33
所有者权益合计		266,987,074.77	387,970,018.18
负债和所有者权益总计		294,281,645.18	419,816,360.89

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2073 元，基金份额总额 221,135,626.32 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-84,676,582.81	73,556,926.65
1. 利息收入		151,224.99	165,703.36
其中：存款利息收入	7.4.7.11	151,021.15	165,653.71
债券利息收入		203.84	49.65
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）		-32,407,985.23	53,320,631.74
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-37,564,031.29	48,101,075.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	41,586.13	2,964.36
资产支持证券投资	7.4.7.13.1	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	5,114,459.93	5,216,592.36
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-52,507,974.58	19,993,032.43
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	88,152.01	77,559.12
减：二、费用		5,040,177.94	5,151,452.08
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,591,982.24	1,660,582.25
2. 托管费	7.4.10.2.2	318,396.43	332,116.44
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,549,440.65	2,618,455.39
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.62	-
7. 其他费用	7.4.7.20	580,358.00	540,298.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-89,716,760.75	68,405,474.57

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 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)	239,592,806.85	148,377,211.33	387,970,018.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-89,716,760.75	-89,716,760.75
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)	-18,457,180.53	-12,809,002.13	-31,266,182.66
其中：1. 基金申购款	41,140,723.17	18,374,949.64	59,515,672.81
2. 基金赎回款	-59,597,903.70	-31,183,951.77	-90,781,855.47
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)	221,135,626.32	45,851,448.45	266,987,074.77
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 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)	209,201,323.44	65,223,635.17	274,424,958.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	68,405,474.57	68,405,474.57
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)	30,391,483.41	14,748,101.59	45,139,585.00
其中：1. 基金申购款	79,887,473.49	38,739,950.17	118,627,423.66
2. 基金赎回款	-49,495,990.08	-23,991,848.58	-73,487,838.66

回款			
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	239,592,806.85	148,377,211.33	387,970,018.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金（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[2013]1209 号文《关于核准汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2013 年 11 月 06 日正式生效，首次设立募集规模为 274,994,745.19 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，以沪深 300 安中动态策略指数的成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪沪深 300 安中动态策略指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 安中动态策略指数收益率 $\times 95\% +$ 金融机构人民币活期存款基准利率（税后） $\times 5\%$

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和债券投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票和债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重

新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动区别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回

基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量

的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 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 4 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；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者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；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

7.4.6.4 企业所得税

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

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

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

7.4.6.5 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和

转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	14,921,853.47	26,139,279.40
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 个月及以上	-	-
其他存款	-	-
合计	14,921,853.47	26,139,279.40

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	286,096,576.31	251,940,695.04	-34,155,881.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	32,000.00	32,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	32,000.00	32,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	286,128,576.31	251,972,695.04	-34,155,881.27
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	349,996,176.91	368,348,270.22	18,352,093.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	188,900.00	188,900.00
	银行间市场	-	-
	合计	188,900.00	188,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	350,185,076.91	368,537,170.22	18,352,093.31

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,894.34	5,043.46
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	302.70	415.30
应收债券利息	1.96	16.21
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	13.50	24.70
合计	3,212.50	5,499.67

注：“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	321,852.77	573,082.77
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	321,852.77	573,082.77

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6.20	879.11
应付信息披露费	300,000.00	280,000.00
应付审计费	80,000.00	60,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	430,006.20	390,879.11

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	239,592,806.85	239,592,806.85
本期申购	41,140,723.17	41,140,723.17
本期赎回（以“-”号填列）	-59,597,903.70	-59,597,903.70
- 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	221,135,626.32	221,135,626.32

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	115,993,330.63	32,383,880.70	148,377,211.33
本期利润	-37,208,786.17	-52,507,974.58	-89,716,760.75
本期基金份额交易产生的变动数	-9,689,771.10	-3,119,231.03	-12,809,002.13
其中：基金申购款	18,898,208.99	-523,259.35	18,374,949.64
基金赎回款	-28,587,980.09	-2,595,971.68	-31,183,951.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,094,773.36	-23,243,324.91	45,851,448.45

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	136,635.80	152,207.44
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	12,603.10	11,220.08
其他	1,782.25	2,226.19
合计	151,021.15	165,653.71

注：“其他”为结算保证金利息收入和直销申购款利息收入。

7.4.7.12 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	852,223,509.01	853,269,417.78
减：卖出股票成本总额	889,787,540.30	805,168,342.76
买卖股票差价收入	-37,564,031.29	48,101,075.02

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年12月 31日	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	453,009.45	90,997.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	411,200.00	88,000.00
减：应收利息总额	223.32	33.44
买卖债券差价收入	41,586.13	2,964.36

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,114,459.93	5,216,592.36
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	5,114,459.93	5,216,592.36

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-52,507,974.58	19,993,032.43
股票投资	-52,507,974.58	19,993,032.43
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他	—	—
2. 衍生工具	—	—
权证投资	—	—
3. 其他	—	—
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	—	—
合计	-52,507,974.58	19,993,032.43

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	88,152.01	77,559.12
合计	88,152.01	77,559.12

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
----	--	---

交易所市场交易费用	2,549,440.65	2,618,455.39
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,549,440.65	2,618,455.39

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	280,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
银行费用	358.00	298.00
合计	580,358.00	540,298.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据中国证监会[2017]13号公告《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的有关规定，经与基金托管人协商一致，本基金的管理人决定自2019年2月14日起，对本基金持有的停牌股票信威集团（代码：600485）按照5.76元进行估值，由此减少交易性金融资产账面价值及公允价值变动收益人民币862,130.08元。

截至财务报表批准日，除上述估值变更事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
上海上投资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
汇添富资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,591,982.24	1,660,582.25
其中：支付销售机构的客户维护费	93,203.15	81,538.07

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

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	318,396.43	332,116.44

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

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 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	14,921,853.47	136,635.80	26,139,279.40	152,207.44

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末(2018 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
601860	紫金银行	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 3 日	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
110049	海尔转债	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 18 日	新债流通受限	100.00	100.00	320	32,000.00	32,000.00	-

7.4.12.2 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
000540	中天金融	2017 年 08 月 21 日	重大资产重组停牌	3.80	2019 年 01 月 02 日	4.38	31,650	143,868.61	120,270.00	-
600030	中信证券	2018 年 12 月 25 日	重大事项停牌	16.01	2019 年 01 月 10 日	17.15	36,004	627,282.30	576,424.04	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大资产重组停牌	10.03	-	-	201,904	3,443,861.58	2,025,097.12	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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;本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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 2018 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	14,921,853.47	-	-	-	-	-	14,921,853.47
结算备付金	672,584.11	-	-	-	-	-	672,584.11
存出保证金	29,846.61	-	-	-	-	-	29,846.61
交易性金融资产	-	-	32,000.00	-	-	251,940,695.04	251,972,695.04
应收利息	-	-	-	-	-	3,212.50	3,212.50
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	100,559.25	-	-	-	-	202,007.18	302,566.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	26,378,887.02	26,378,887.02
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	15,724,843.44	-	32,000.00	-	-	278,524,801.74	294,281,645.18
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,249.61	3,249.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	116,634.62	116,634.62
应付托管费	-	-	-	-	-	23,326.91	23,326.91
应付证券	-	-	-	-	-	26,399,500.29	26,399,500.29

清算款							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	321,852.77	321,852.77
应付税费	-	-	-	-	-	0.01	0.01
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	430,006.20	430,006.20
负债总计	-	-	-	-	-	27,294,570.41	27,294,570.41
利率敏感度缺口	15,724,843.44	-	32,000.00	-	-	251,230,231.33	266,987,074.77
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	26,139,279.40	-	-	-	-	-	26,139,279.40
结算备付金	923,067.48	-	-	-	-	-	923,067.48

存出 保证金	55,052.21	-	-	-	-	-	55,052.21
交易 性金 融资 产	-	-	188,900.00	-	-	368,348,270.22	368,537,170.22
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
应收 利息	-	-	-	-	-	5,499.67	5,499.67
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 申购 款	30,687.76	-	-	-	-	36,891.58	67,579.34
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	24,088,712.57	24,088,712.57
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	27,148,086.85	-	188,900.00	-	-	392,479,374.04	419,816,360.89
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	242,414.03	242,414.03
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	165,167.60	165,167.60
应付 托管 费	-	-	-	-	-	33,033.51	33,033.51
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	30,441,765.69	30,441,765.69

卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	573,082.77	573,082.77
应付 税费	-	-	-	-	-	-	-
应付 利息	-	-	-	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	390,879.11	390,879.11
负债 总计	-	-	-	-	-	31,846,342.71	31,846,342.71
利率 敏感 度缺 口	27,148,086.85	-	188,900.00	-	-	360,633,031.33	387,970,018.18

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

基金持有的可转债的市场风险在附注 7.4.13.4.3.2 中进行披露；除此之外，本基金本报告期末及上年度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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 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	251,940,695.04	94.36	368,348,270.22	94.94
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	32,000.00	0.01	188,900.00	0.05
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	251,972,695.04	94.37	368,537,170.22	94.99

注：本基金投资于沪深 300 安中动态策略指数的成份股的组合比例不低于基金资产的 90%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

7.4.13.4.3.2 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。	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 安中动态策略指数上涨 5%	12,692,411.64	19,524,864.91
	沪深 300 安中动态策略指数下降 5%	-12,692,411.64	-19,524,864.91

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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 249,168,758.08 元，属于第二层次的余额为人民币 2,803,936.96 元，无划分为第三层次余额（于 2017 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 353,224,323.32 元，属于第二层次的余额为人民币 15,075,392.60 元，属于第三层次的余额为人民币 237,454.30 元）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值期末无余额，期初余额为人民币 237,454.30 元，本期减少人民币 237,454.30 元。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 20 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	251,940,695.04	85.61
	其中：股票	251,940,695.04	85.61
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	32,000.00	0.01
	其中：债券	32,000.00	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	15,594,437.58	5.30
8	其他各项资产	26,714,512.56	9.08
9	合计	294,281,645.18	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,848,625.00	0.69
B	采矿业	18,503,523.67	6.93
C	制造业	126,183,420.42	47.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	56,833,835.39	21.29
E	建筑业	4,935,790.77	1.85
F	批发和零售业	5,036,946.09	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	3,826,508.28	1.43
H	住宿和餐饮业	—	—

I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,289,685.43	4.23
J	金融业	14,627,436.08	5.48
K	房地产业	2,182,164.50	0.82
L	租赁和商务服务业	1,985,537.28	0.74
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	323,055.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,488,968.10	0.56
R	文化、体育和娱乐业	572,962.40	0.21
S	综合	-	-
	合计	249,638,458.41	93.50

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	2,131,820.83	0.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	50,145.80	0.02
K	房地产业	120,270.00	0.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,302,236.63	0.86

8.2.3 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投资股票。

8.3 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

8.3.1 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	22,583	13,324,195.83	4.99
2	600900	长江电力	815,362	12,947,948.56	4.85
3	600887	伊利股份	448,132	10,253,260.16	3.84
4	000858	五粮液	149,169	7,589,718.72	2.84
5	600011	华能国际	984,800	7,267,824.00	2.72
6	600886	国投电力	901,439	7,256,583.95	2.72
7	600795	国电电力	2,690,248	6,887,034.88	2.58
8	601985	中国核电	1,088,100	5,734,287.00	2.15
9	600023	浙能电力	979,811	4,634,506.03	1.74
10	002304	洋河股份	48,778	4,620,252.16	1.73
11	603288	海天味业	66,400	4,568,320.00	1.71
12	600050	中国联通	870,268	4,499,285.56	1.69
13	000063	中兴通讯	225,228	4,412,216.52	1.65
14	600028	中国石化	837,633	4,230,046.65	1.58
15	601857	中国石油	548,470	3,954,468.70	1.48
16	600027	华电国际	823,200	3,910,200.00	1.46
17	600674	川投能源	443,191	3,842,465.97	1.44
18	600276	恒瑞医药	64,101	3,381,327.75	1.27
19	000651	格力电器	85,615	3,055,599.35	1.14
20	000333	美的集团	82,007	3,022,778.02	1.13
21	601318	中国平安	49,788	2,793,106.80	1.05
22	000568	泸州老窖	66,458	2,702,182.28	1.01
23	601933	永辉超市	337,992	2,659,997.04	1.00
24	002415	海康威视	99,740	2,569,302.40	0.96
25	601088	中国神华	138,111	2,480,473.56	0.93
26	601991	大唐发电	762,900	2,403,135.00	0.90
27	000895	双汇发展	93,842	2,213,732.78	0.83
28	600487	亨通光电	123,800	2,110,790.00	0.79
29	601225	陕西煤业	269,966	2,008,547.04	0.75
30	600025	华能水电	619,000	1,949,850.00	0.73

31	002311	海大集团	81,300	1,883,721.00	0.71
32	600522	中天科技	227,300	1,852,495.00	0.69
33	600498	烽火通信	65,000	1,850,550.00	0.69
34	002714	牧原股份	64,300	1,848,625.00	0.69
35	600438	通威股份	207,100	1,714,788.00	0.64
36	601668	中国建筑	292,274	1,665,961.80	0.62
37	000725	京东方 A	630,538	1,658,314.94	0.62
38	000876	新 希 望	226,336	1,647,726.08	0.62
39	600104	上汽集团	61,182	1,631,723.94	0.61
40	300136	信维通信	72,500	1,566,725.00	0.59
41	600019	宝钢股份	239,674	1,557,881.00	0.58
42	600585	海螺水泥	52,325	1,532,076.00	0.57
43	601138	工业富联	110,400	1,279,536.00	0.48
44	600309	万华化学	43,875	1,228,061.25	0.46
45	601766	中国中车	135,756	1,224,519.12	0.46
46	600809	山西汾酒	34,900	1,223,245.00	0.46
47	300059	东方财富	99,924	1,209,080.40	0.45
48	600036	招商银行	47,489	1,196,722.80	0.45
49	000538	云南白药	14,835	1,097,196.60	0.41
50	601888	中国国旅	17,038	1,025,687.60	0.38
51	601899	紫金矿业	292,975	978,536.50	0.37
52	002230	科大讯飞	38,882	958,052.48	0.36
53	002475	立讯精密	64,055	900,613.30	0.34
54	601988	中国银行	246,734	890,709.74	0.33
55	600690	青岛海尔	63,828	884,017.80	0.33
56	601166	兴业银行	57,863	864,473.22	0.32
57	600518	康美药业	89,599	825,206.79	0.31
58	002594	比亚迪	15,247	777,597.00	0.29
59	002044	美年健康	50,960	761,852.00	0.29
60	600703	三安光电	67,026	758,064.06	0.28
61	600436	片仔癀	8,650	749,522.50	0.28
62	600583	海油工程	152,337	746,451.30	0.28
63	601328	交通银行	127,193	736,447.47	0.28
64	600688	上海石化	147,541	736,229.59	0.28
65	603156	养元饮品	17,600	731,808.00	0.27
66	601390	中国中铁	104,570	730,944.30	0.27
67	300015	爱尔眼科	27,647	727,116.10	0.27
68	601186	中国铁建	65,766	714,876.42	0.27
69	600010	包钢股份	478,088	707,570.24	0.27
70	002008	大族激光	23,171	703,471.56	0.26
71	603993	洛阳钼业	186,776	702,277.76	0.26
72	600016	民生银行	120,376	689,754.48	0.26

73	600570	恒生电子	13,239	688,163.22	0.26
74	002027	分众传媒	130,312	682,834.88	0.26
75	600196	复星医药	29,293	681,648.11	0.26
76	600271	航天信息	29,563	676,697.07	0.25
77	000661	长春高新	3,800	665,000.00	0.25
78	002024	苏宁易购	67,459	664,471.15	0.25
79	600009	上海机场	13,066	663,230.16	0.25
80	601006	大秦铁路	80,193	659,988.39	0.25
81	300003	乐普医疗	31,000	645,110.00	0.24
82	601288	农业银行	178,893	644,014.80	0.24
83	300142	沃森生物	33,200	634,120.00	0.24
84	600352	浙江龙盛	65,085	628,070.25	0.24
85	601600	中国铝业	170,938	606,829.90	0.23
86	600332	白云山	16,551	591,863.76	0.22
87	601898	中煤能源	126,000	585,900.00	0.22
88	000983	西山煤电	105,737	580,496.13	0.22
89	600030	中信证券	36,004	576,424.04	0.22
90	600031	三一重工	68,785	573,666.90	0.21
91	600867	通化东宝	40,900	568,510.00	0.21
92	600547	山东黄金	18,745	567,036.25	0.21
93	002236	大华股份	49,307	565,058.22	0.21
94	601607	上海医药	33,159	563,703.00	0.21
95	600660	福耀玻璃	24,715	563,007.70	0.21
96	600176	中国巨石	57,800	558,926.00	0.21
97	600588	用友网络	26,055	554,971.50	0.21
98	002466	天齐锂业	18,535	543,446.20	0.20
99	600100	同方股份	55,587	540,861.51	0.20
100	000963	华东医药	20,386	539,413.56	0.20
101	600188	兖州煤业	61,038	535,913.64	0.20
102	601989	中国重工	125,800	534,650.00	0.20
103	600000	浦发银行	54,545	534,541.00	0.20
104	000423	东阿阿胶	13,258	524,353.90	0.20
105	300122	智飞生物	13,500	523,260.00	0.20
106	600741	华域汽车	28,400	522,560.00	0.20
107	000002	万科A	21,923	522,205.86	0.20
108	000338	潍柴动力	67,560	520,212.00	0.19
109	002007	华兰生物	15,724	515,747.20	0.19
110	600111	北方稀土	58,008	508,730.16	0.19
111	002422	科伦药业	24,300	501,795.00	0.19
112	002456	欧菲科技	54,487	500,735.53	0.19
113	600535	天士力	25,581	491,155.20	0.18
114	600516	方大炭素	28,800	481,248.00	0.18

115	000413	东旭光电	105,876	476,442.00	0.18
116	300408	三环集团	28,100	475,452.00	0.18
117	601012	隆基股份	26,880	468,787.20	0.18
118	600406	国电南瑞	24,970	462,694.10	0.17
119	000100	TCL 集团	186,965	458,064.25	0.17
120	002460	赣锋锂业	20,650	455,952.00	0.17
121	600085	同仁堂	15,644	430,210.00	0.16
122	600339	中油工程	115,700	419,991.00	0.16
123	601601	中国太保	14,655	416,641.65	0.16
124	603799	华友钴业	13,680	411,904.80	0.15
125	000703	恒逸石化	34,600	398,592.00	0.15
126	600219	南山铝业	187,560	395,751.60	0.15
127	601169	北京银行	69,150	387,931.50	0.15
128	600048	保利地产	32,292	380,722.68	0.14
129	000001	平安银行	40,360	378,576.80	0.14
130	600489	中金黄金	43,033	369,223.14	0.14
131	002001	新 和 成	24,000	360,240.00	0.13
132	002241	歌尔股份	51,898	357,058.24	0.13
133	002065	东华软件	50,748	352,698.60	0.13
134	002179	中航光电	10,400	350,272.00	0.13
135	600362	江西铜业	26,501	348,753.16	0.13
136	601808	中海油服	40,300	344,162.00	0.13
137	601669	中国电建	70,243	341,380.98	0.13
138	600089	特变电工	50,257	341,245.03	0.13
139	000630	铜陵有色	165,910	326,842.70	0.12
140	600837	海通证券	37,095	326,436.00	0.12
141	002493	荣盛石化	32,300	325,907.00	0.12
142	000503	国新健康	20,339	322,983.32	0.12
143	000709	河钢股份	112,045	318,207.80	0.12
144	603858	步长制药	12,550	317,264.00	0.12
145	300017	网宿科技	40,359	316,010.97	0.12
146	600177	雅戈尔	43,720	314,346.80	0.12
147	600566	济川药业	9,300	311,829.00	0.12
148	600029	南方航空	46,830	310,951.20	0.12
149	002558	巨人网络	16,000	309,920.00	0.12
150	300296	利亚德	40,300	309,907.00	0.12
151	002271	东方雨虹	23,800	308,210.00	0.12
152	000786	北新建材	22,300	306,848.00	0.11
153	601111	中国国航	40,065	306,096.60	0.11
154	002624	完美世界	10,900	303,565.00	0.11
155	300072	三聚环保	30,570	300,808.80	0.11
156	601992	金隅集团	85,900	300,650.00	0.11

157	600221	海航控股	158,817	298,575.96	0.11
158	600637	东方明珠	28,453	291,358.72	0.11
159	300124	汇川技术	14,169	285,363.66	0.11
160	601229	上海银行	25,436	284,628.84	0.11
161	002202	金风科技	28,459	284,305.41	0.11
162	601877	正泰电器	11,600	281,184.00	0.11
163	002252	上海莱士	35,070	280,910.70	0.11
164	600066	宇通客车	23,630	280,015.50	0.10
165	600549	厦门钨业	22,730	274,578.40	0.10
166	300144	宋城演艺	12,800	273,280.00	0.10
167	601818	光大银行	73,710	272,727.00	0.10
168	600893	航发动力	12,507	271,652.04	0.10
169	600398	海澜之家	31,900	270,512.00	0.10
170	000792	盐湖股份	38,354	267,710.92	0.10
171	601211	国泰君安	17,400	266,568.00	0.10
172	600346	恒力股份	20,000	265,000.00	0.10
173	601800	中国交建	23,475	264,328.50	0.10
174	000768	中航飞机	19,433	257,292.92	0.10
175	600115	东方航空	53,911	256,077.25	0.10
176	601618	中国中冶	80,721	251,042.31	0.09
177	002294	信立泰	12,000	250,680.00	0.09
178	000898	鞍钢股份	48,500	248,805.00	0.09
179	601688	华泰证券	15,258	247,179.60	0.09
180	601727	上海电气	48,891	241,521.54	0.09
181	600068	葛洲坝	38,050	240,476.00	0.09
182	002153	石基信息	9,136	237,170.56	0.09
183	601216	君正集团	89,434	234,317.08	0.09
184	600018	上港集团	45,228	234,281.04	0.09
185	601360	三六零	11,400	232,218.00	0.09
186	300033	同花顺	6,000	229,200.00	0.09
187	000625	长安汽车	34,338	226,287.42	0.08
188	000157	中联重科	62,815	223,621.40	0.08
189	300070	碧水源	28,230	220,194.00	0.08
190	600015	华夏银行	29,710	219,556.90	0.08
191	000425	徐工机械	66,283	214,094.09	0.08
192	601919	中远海控	52,614	212,560.56	0.08
193	600482	中国动力	9,500	211,565.00	0.08
194	601939	建设银行	32,374	206,222.38	0.08
195	603160	汇顶科技	2,600	204,620.00	0.08
196	300024	机器人	15,358	203,032.76	0.08
197	002601	龙蟠佰利	15,900	195,570.00	0.07
198	002572	索菲亚	11,500	192,625.00	0.07

199	600919	江苏银行	32,200	192,234.00	0.07
200	002142	宁波银行	11,723	190,147.06	0.07
201	001979	招商蛇口	10,948	189,947.80	0.07
202	002411	延安必康	8,900	187,612.00	0.07
203	600170	上海建工	60,842	184,351.26	0.07
204	601018	宁波港	55,189	184,331.26	0.07
205	603833	欧派家居	2,300	183,356.00	0.07
206	600977	中国电影	12,800	183,296.00	0.07
207	601009	南京银行	27,936	180,466.56	0.07
208	002085	万丰奥威	23,200	179,800.00	0.07
209	002081	金螳螂	21,982	178,054.20	0.07
210	000938	紫光股份	5,640	176,306.40	0.07
211	600739	辽宁成大	16,784	175,560.64	0.07
212	000776	广发证券	13,728	174,071.04	0.07
213	002555	三七互娱	18,400	173,696.00	0.07
214	600297	广汇汽车	42,490	172,509.40	0.06
215	002508	老板电器	8,500	171,615.00	0.06
216	002602	世纪华通	8,300	171,395.00	0.06
217	601336	新华保险	3,924	165,749.76	0.06
218	002050	三花智控	12,600	159,894.00	0.06
219	600038	中直股份	4,278	159,826.08	0.06
220	601628	中国人寿	7,751	158,042.89	0.06
221	000959	首钢股份	41,000	152,930.00	0.06
222	600153	建发股份	21,666	152,745.30	0.06
223	601117	中国化学	28,000	150,080.00	0.06
224	000839	中信国安	44,100	148,617.00	0.06
225	601333	广深铁路	46,961	148,396.76	0.06
226	600999	招商证券	10,756	144,130.40	0.05
227	600118	中国卫星	8,240	142,716.80	0.05
228	300433	蓝思科技	21,699	141,260.49	0.05
229	002310	东方园林	20,000	139,200.00	0.05
230	600340	华夏幸福	5,461	138,982.45	0.05
231	600415	小商品城	38,120	133,038.80	0.05
232	002352	顺丰控股	4,000	131,000.00	0.05
233	000166	申万宏源	31,430	127,920.10	0.05
234	601021	春秋航空	3,810	121,196.10	0.05
235	601633	长城汽车	21,239	118,938.40	0.04
236	300251	光线传媒	15,314	116,386.40	0.04
237	601238	广汽集团	11,100	114,219.00	0.04
238	600704	物产中大	23,700	108,546.00	0.04
239	601228	广州港	27,400	108,504.00	0.04
240	000826	启迪桑德	9,900	102,861.00	0.04

241	600606	绿地控股	16,700	102,037.00	0.04
242	600383	金地集团	10,530	101,298.60	0.04
243	601901	方正证券	18,800	99,828.00	0.04
244	600372	中航电子	7,676	99,634.48	0.04
245	601155	新城控股	4,200	99,498.00	0.04
246	601377	兴业证券	21,326	98,952.64	0.04
247	000415	渤海租赁	26,500	95,400.00	0.04
248	000069	华侨城 A	14,887	94,532.45	0.04
249	600705	中航资本	21,238	90,049.12	0.03
250	000783	长江证券	17,242	88,796.30	0.03
251	603260	合盛硅业	1,900	83,220.00	0.03
252	601788	光大证券	9,308	81,631.16	0.03
253	601998	中信银行	14,409	78,529.05	0.03
254	002468	申通快递	4,600	75,670.00	0.03
255	601611	中国核建	11,500	75,095.00	0.03
256	002625	光启技术	7,400	73,260.00	0.03
257	601555	东吴证券	10,685	71,589.50	0.03
258	601997	贵阳银行	6,700	71,556.00	0.03
259	600926	杭州银行	9,600	71,040.00	0.03
260	600109	国金证券	9,502	68,034.32	0.03
261	601212	白银有色	22,900	67,555.00	0.03
262	001965	招商公路	8,300	66,649.00	0.02
263	002925	盈趣科技	1,500	65,820.00	0.02
264	002146	荣盛发展	7,896	62,773.20	0.02
265	000728	国元证券	8,988	62,736.24	0.02
266	002673	西部证券	8,080	61,973.60	0.02
267	601198	东兴证券	6,300	60,228.00	0.02
268	600208	新潮中宝	19,633	56,935.70	0.02
269	002797	第一创业	9,740	52,790.80	0.02
270	600233	圆通速递	4,900	49,000.00	0.02
271	601828	美凯龙	4,400	48,576.00	0.02
272	000961	中南建设	8,200	46,002.00	0.02
273	600369	西南证券	13,158	45,789.84	0.02
274	600816	安信信托	10,264	44,853.68	0.02
275	601881	中国银河	5,900	40,238.00	0.02
276	600909	华安证券	8,500	40,120.00	0.02
277	000627	天茂集团	7,100	39,831.00	0.01
278	000671	阳光城	7,300	37,887.00	0.01
279	600061	国投资本	4,100	36,859.00	0.01
280	000402	金融街	5,434	34,994.96	0.01
281	600390	五矿资本	2,500	17,400.00	0.01
282	601838	成都银行	1,900	15,295.00	0.01

283	601108	财通证券	1,700	12,274.00	0.00
284	601878	浙商证券	1,600	11,616.00	0.00

8.3.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600485	信威集团	201,904	2,025,097.12	0.76
2	000540	中天金融	31,650	120,270.00	0.05
3	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.02
4	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.02
5	603629	利通电子	1,051	40,684.21	0.02

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600900	长江电力	28,328,694.27	7.30
2	600887	伊利股份	27,560,756.56	7.10
3	000858	五粮液	21,351,277.47	5.50
4	600519	贵州茅台	21,333,896.44	5.50
5	600886	国投电力	21,036,976.25	5.42
6	600028	中国石化	20,234,989.70	5.22
7	600011	华能国际	20,232,733.43	5.22
8	601985	中国核电	20,060,025.63	5.17
9	600276	恒瑞医药	19,804,375.00	5.10
10	600795	国电电力	19,598,952.00	5.05
11	601857	中国石油	17,294,822.59	4.46
12	601318	中国平安	16,772,664.21	4.32
13	600023	浙能电力	14,944,753.02	3.85
14	601088	中国神华	14,439,816.00	3.72
15	002415	海康威视	13,171,982.34	3.40
16	002304	洋河股份	12,853,613.00	3.31
17	600674	川投能源	12,348,615.46	3.18
18	601225	陕西煤业	11,460,158.00	2.95
19	600050	中国联通	11,281,414.99	2.91
20	300136	信维通信	9,832,659.07	2.53
21	000725	京东方 A	8,863,154.00	2.28
22	600522	中天科技	8,508,002.36	2.19
23	000333	美的集团	8,370,175.91	2.16
24	601991	大唐发电	8,215,095.00	2.12
25	000568	泸州老窖	8,154,768.06	2.10

26	603288	海天味业	8,082,924.43	2.08
27	000651	格力电器	7,889,211.19	2.03

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。

8.4.2 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	600887	伊利股份	33,251,225.05	8.57
2	600276	恒瑞医药	32,282,711.60	8.32
3	600519	贵州茅台	26,446,661.29	6.82
4	000858	五粮液	25,856,323.57	6.66
5	600900	长江电力	23,327,688.43	6.01
6	600028	中国石化	18,774,067.04	4.84
7	601318	中国平安	16,978,327.03	4.38
8	601857	中国石油	16,138,050.83	4.16
9	601985	中国核电	15,912,226.24	4.10
10	600886	国投电力	15,610,799.40	4.02
11	002304	洋河股份	15,235,683.55	3.93
12	601088	中国神华	14,610,196.99	3.77
13	600795	国电电力	14,313,632.00	3.69
14	600011	华能国际	14,201,000.59	3.66
15	600518	康美药业	12,885,399.19	3.32
16	002415	海康威视	12,475,276.28	3.22
17	000538	云南白药	11,996,393.46	3.09
18	601225	陕西煤业	11,417,067.00	2.94
19	600023	浙能电力	11,028,863.00	2.84
20	300136	信维通信	10,861,985.71	2.80
21	600050	中国联通	10,267,670.82	2.65
22	000568	泸州老窖	9,860,828.61	2.54
23	600674	川投能源	9,430,659.32	2.43
24	601933	永辉超市	9,072,248.00	2.34
25	600196	复星医药	8,947,008.60	2.31
26	600522	中天科技	8,441,511.59	2.18
27	000725	京东方 A	8,374,257.00	2.16
28	000333	美的集团	8,083,283.00	2.08
29	000651	格力电器	7,896,347.00	2.04

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。

8.4.3 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	825,887,939.70
卖出股票收入（成交）总额	852,223,509.01

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。

8.5 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）	32,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	32,000.00	0.01

8.6 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	110049	海尔转债	320	32,000.00	0.01

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	29,846.61
2	应收证券清算款	26,378,887.02
3	应收股利	—
4	应收利息	3,212.50
5	应收申购款	302,566.43
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	26,714,512.56

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 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	公司名称	流通受限部分的公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	2,025,097.12	0.76	重大资产重组
2	000540	中天金融	120,270.00	0.05	重大资产重组
3	601860	紫金银行	50,145.80	0.02	新股流通受限

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
4,495	49,195.91	153,416,135.08	69.38	67,719,491.24	30.62

9.2 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	327,461.42	0.15

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2013 年 11 月 6 日) 基金份额总额	274,994,745.19
本报告期期初基金份额总额	239,592,806.85
本报告期基金总申购份额	41,140,723.17
减：本报告期基金总赎回份额	59,597,903.70
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	221,135,626.32

注：其中“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

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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生效公告》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生效公告》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生效公告》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、《汇添富行业整合主题混合型证券投资基金基金合同生效公告》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。

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

6、《汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，陈加荣先生和胡娜女士共同担任该基金的基金经理。

7、基金管理人于 2018 年 2 月 14 日公告，增聘胡娜女士为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、基金管理人于 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，增聘郑慧莲女士为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生效公告》于 2018 年 3 月 8 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生共同担任该基金的基金经理。

11、基金管理人于 2018 年 3 月 20 日公告，增聘赵鹏飞先生为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，与陈加荣先生和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生效公告》于 2018 年 3 月 23 日正式生效，吴振翔先生和许一尊先生共同担任该基金的基金经理。

13、基金管理人于 2018 年 4 月 3 日公告，增聘郑慧莲女士为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生效公告》于 2018 年 4 月 16 日正式生效，吴江宏先生和胡娜女士共同担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生效公告》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生效公告》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，增聘徐寅喆女士为汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、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的基金经理，蒋文玲女士不再担任上述基金的基金经理。

18、基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，增聘陶然先生为汇添富全额宝货币市场基金、汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，徐寅喆女士不再担任上述基金的基金经理。

19、基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，增聘陶然先生为汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，陆文磊先生和徐寅喆女士不再担任该基金的基金经理。

20、基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，增聘徐寅喆女士为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。

21、基金管理人于 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。

22、《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）基金合同生效公告》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。

23、基金管理人于 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。

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

25、《汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同生效公告》于 2018 年 7 月 5 日正式生效，刘伟林先生任该基金的基金经理。

26、基金管理人于 2018 年 7 月 7 日公告，增聘曾刚先生和郑慧莲女士为汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，李怀定先生不再担任该基金的基金经理。

27、基金管理人于 2018 年 7 月 7 日公告，增聘胡娜女士为汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）的基金经理，与陆文磊先生、李怀定先生共同管理该基金。

28、基金管理人于 2018 年 7 月 7 日公告，增聘何旻先生、杨璿先生和刘江先生为汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理，与刘伟林先生共同管理

该基金。

29、基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告，李怀定先生不再担任汇添富纯债债券型证券投资基金(LOF)、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的基金经理，由陆文磊先生和胡娜女士管理该基金。

30、基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告，李怀定先生不再担任汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，由陆文磊先生单独管理上述基金。

31、基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告，李怀定先生不再担任汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，由陆文磊先生、郑慧莲女士和胡娜女士管理该基金。

32、基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告，李怀定先生不再担任汇添富睿丰混合型证券投资基金的基金经理，增聘蒋文玲女士为该基金的基金经理，与赵鹏飞先生共同管理该基金。

33、基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告，李怀定先生不再担任汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理，由曾刚先生单独管理上述基金。

34、基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告，增聘蒋文玲女士为汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，李怀定先生不再担任该基金的基金经理。

35、基金管理人于 2018 年 8 月 4 日公告，李怀定先生不再担任汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金的基金经理，由何旻先生单独管理该基金。

36、基金管理人于 2018 年 8 月 8 日公告，增聘温开强先生为汇添富理财 30 天债券型证券投资基金的基金经理，与徐寅喆女士共同管理该基金。

37、《汇添富创新医药主题混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 8 月 8 日正式生效，刘江先生和郑磊先生共同担任该基金的基金经理。

38、基金管理人于 2018 年 8 月 23 日公告，增聘徐光先生为汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，与陆文磊先生共同管理上述基金。

39、《汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 9 月 21 日正式生效，陈健玮先生任该基金的基金经理。

40、《汇添富全球消费行业混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 9 月 21 日正式生效，胡昕炜先生和郑慧莲女士共同担任该基金的基金经理。

41、基金管理人于 2018 年 9 月 29 日公告，增聘吴江宏先生为汇添富双利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的基金经理，与陈加荣先生、郑慧莲女士共同管理

上述基金。

42、基金管理人于 2018 年 9 月 29 日公告，增聘徐光先生为汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理上述基金。

43、《中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 10 月 23 日正式生效，过蓓蓓女士任该基金的基金经理。

44、基金管理人于 2018 年 11 月 17 日公告，陈加荣先生不再担任汇添富双利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的基金经理，由吴江宏先生和郑慧莲女士管理上述基金。

45、基金管理人于 2018 年 11 月 17 日公告，陈加荣先生不再担任汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金的基金经理，由徐光先生单独管理上述基金。

46、基金管理人于 2018 年 11 月 17 日公告，陈加荣先生不再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，由赵鹏飞先生和胡娜女士管理该基金。

47、《汇添富经典成长定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 12 月 5 日正式生效，雷鸣先生任该基金的基金经理。

48、《汇添富短债债券型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 12 月 13 日正式生效，蒋文玲女士任该基金的基金经理。

49、《汇添富消费升级混合型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 12 月 21 日正式生效，胡昕炜先生和郑慧莲女士共同担任该基金的基金经理。

50、《汇添富丰润中短债债券型证券投资基金基金合同生效公告》于 2018 年 12 月 24 日正式生效，徐光先生和蒋文玲女士共同担任该基金的基金经理。

51、基金管理人于 2018 年 12 月 26 日公告，增聘茹奕菡女士为汇添富安心中国债券型证券投资基金的基金经理，与何旻先生共同管理该基金。

52、《汇添富养老目标日期 2030 三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同生效公告》于 2018 年 12 月 27 日正式生效，蔡健林先生任该基金的基金经理。

53、基金管理人于 2018 年 12 月 29 日公告，倪健先生不再担任汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金的基金经理，增聘杨威风先生为该基金的基金经理，与余中强先生共同管理该基金。

54、基金管理人于 2018 年 12 月 29 日公告，增聘杨威风先生为汇添富香港优势精选混合型证

券投资基金的基金经理，倪健先生不再担任该基金的基金经理。

55、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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2013 年 11 月 6 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币捌万元整。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
国金证券	2	1,674,982,405.96	100.00%	1,548,585.41	100.00%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	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。

11.7.2 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	成交金额	占当期权证成交总额

				比例		的比例
国金证券	453,009.45	100.00%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

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：

本基金本报告期内退租 3 家证券公司的 3 个交易单元：东兴证券（上交所单元）、中投证券（上交所单元）、中信证券（深交所单元）。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2017 年资产净值的公告	公司网站	2018-01-02
2	汇添富基金管理有限公司旗下公募基金 2017 年第 4 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-01-22
3	关于汇添富基金管理股份有限公司旗下 93 只基金修订基金合同的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 公司网站, 深交所	2018-03-24
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下 93 只基金 2017 年年度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-03-28
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加工商银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-03-30
6	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	2018-03-30
7	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	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-03-31

	并参与费率优惠活动的公告		
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加电盈基金为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-04-09
9	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	2018-04-19
10	汇添富基金旗下 99 只基金 2018 年第 1 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-04-21
11	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	2018-04-23
12	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	2018-06-09
13	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金更新招募说明书摘要 (2018 年第 1 号)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-06-15
14	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	2018-06-20
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2018 半年资产净值的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-06-30
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加钜派钰茂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	2018-07-11
17	汇添富基金管理股份有限公司旗下 108 只基金 2018 年 2 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-07-18
18	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加朝阳永续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	2018-07-19
19	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加嘉实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	2018-07-26
20	汇添富基金管理股份有限公司旗下 108 只基金 2018 年半年度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-08-25
21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加挖财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	2018-09-21
22	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	2018-10-09
23	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-10-10

	公告		
24	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在肯特瑞最低申购金额、最低赎回份额和最低账户持有份额的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-10-20
25	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在肯特瑞最低定期定额投资金额的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-10-23
26	汇添富基金旗下 111 只基金 2018 年第 3 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018-10-26
27	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加有鱼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	2018-11-20
28	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加阳光人寿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	2018-12-06
29	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加百度百盈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	2018-12-12
30	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金更新招募说明书 (2018 年第 2 号)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018-12-18

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		的时间 区间					
机构	1	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	154,184,079.99	-	1,538,550.00	152,645,529.99	69.03
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数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、报告期内汇添富沪深 300 安中动态策略指数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。

13.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

13.3 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 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

2019 年 03 月 26 日