

汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资 基金 2019 年半年度报告

2019 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
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	42
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	42

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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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情况	43
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	47
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	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金
基金简称	添富价值多因子股票
基金主代码	005530
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 23 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	110,272,064.45 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	本基金主要投资于价值型行业的股票，采用基金管理人指数与量化投资团队开发的多因子量化策略进行选股。本基金在股票投资过程中将坚持量化模型驱动的投资决策流程，强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险，力争基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	010-67595096
传真	021-28932998	010-66275853
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼	北京市西城区闹市口大街一号院一号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	李文	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	23,097,013.57
本期利润	38,348,161.47
加权平均基金份额本期利润	0.2472
本期加权平均净值利润率	25.66%
本期基金份额净值增长率	23.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,020,192.80
期末可供分配基金份额利润	0.0274
期末基金资产净值	114,414,239.15
期末基金份额净值	1.0376
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	3.76%

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

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

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

3.2 基金净值表现

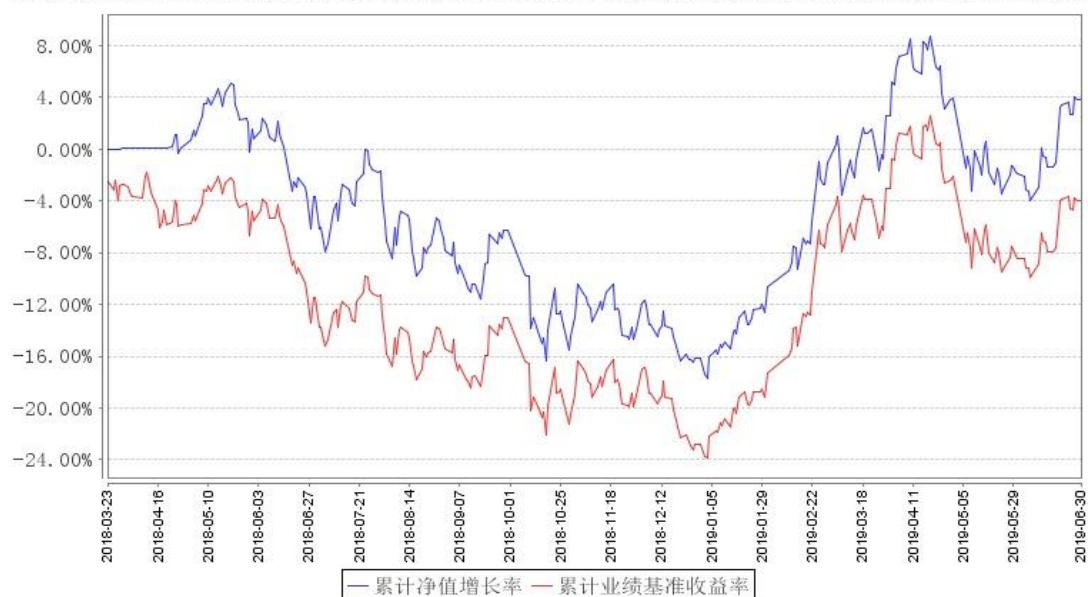
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.79%	1.15%	4.86%	1.04%	0.93%	0.11%

过去三个月	1.17%	1.42%	-1.02%	1.38%	2.19%	0.04%
过去六个月	23.72%	1.40%	24.24%	1.40%	-0.52%	0.00%
过去一年	7.77%	1.38%	8.35%	1.38%	-0.58%	0.00%
自基金合同 生效日起至 今	3.76%	1.29%	-4.04%	1.31%	7.80%	-0.02%

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

添富价值多因子股票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（2018 年 03 月 23 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立。目前，公司注册资本金为 132,724,224 元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公

司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

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

2019 上半年，汇添富基金新成立 13 只公开募集证券投资基金，包括 5 只债券型基金、4 只混合型基金、2 只基金中基金、2 只指数基金联接基金。截至 2019 年 6 月 30 日，公司共管理 133 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许一尊	汇添富成长多因子股票基金、添富价值多因子股票基金的基金经理。	2018年3月23日	-	9	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。
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	2018年3月23日	-	13	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

	<p>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。</p>			<p>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</p>
--	--	--	--	---

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

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，支撑市场向上的因素包括国内改革的持续推进、稳健宽松的货币环境以及资本市场扩大对外开放引发的外资持续流入。改革方面，减税降费政策逐步落地，城镇化、区域协同发展、国企改革、消费促进等政策持续推进；以科创板、注册制为代表金融供给侧改革政策稳步出台，提升资本市场定价效率和服务实体经济能力。同时，MSCI、富时罗素等指数供应商提升 A 股纳入比例，外资配置需求提升，陆股通北向资金持续流入。

导致市场波动的因素包括投资者对经济基本面的预期变化，对通胀的担忧和中美经贸争端的边际变化。上半年经济基本面整体保持韧性，一季度由于减税和托底政策效果显现，经济数据较为理想，同时中美经贸谈判持续推进，市场普遍较为乐观；二季度部分生产及需求数据下滑，国外偏弱的基本面影响出口，猪价波动影响通胀预期，中美贸易争端呈现长期性和复杂性，随着华为事件发酵，争端从贸易领域衍生到科技领域，市场受此影响转为下跌和震荡；季末部分经济数据降幅收窄，积极因素显现，物价回落，通胀预期降温，G20 会议中美贸易出现转机，市场重新转为乐观。

市场风格方面，上半年风格切换较为频繁，一月以大盘蓝筹为主导，市场关注安全性；二月到三月上旬的估值修复行情中，中小市值及题材、概念类股票迅速上涨；三月中下旬开始市场震荡幅度加大，关注点重回公司基本面，高质量、盈利能力强、成长稳健、低估值、高分红等基本面风格获得了较为持续的超额收益。

报告期内，本基金遵循量化基金投资原则，相对业绩比较基准保持了相对均衡的行业配置和风格配置，在质量、盈利、成长、估值、预期以及市场面选股因子上保持了较均衡的暴露。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0376 元；本报告期基金份额净值增长率为 23.72%，业绩比较基准收益率为 24.24%。

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，长期看，在减税降费叠加供给侧改革推进的大背景下，经济活力进一步激发，为权益市场提供较好基本面基础；“房住不炒”背景下居民资产的转移配置，产品净值化管理和资本市场扩大对外开放带来的境内外机构的配置趋势，为权益市场提供较好的资金基础。中短期看，影响市场的因素包括经济基本面、流动性、改革政策以及中美经贸争端的边际变化。经济基本面角度，下半年加征关税影响开始显现，在政策逆周期调节，统筹做好“六稳”背景下，经济形势或将趋于平稳，同时一些积极的因素将逐渐显现，市场可能提前有所反应。流动性角度，当前进一步宽松可能性较小，但在国际多个经济体进入降息通道，美国大概率降息背景下，国内货币政策的空间会相对扩大。中美贸易角度，上半年经历了有好转差，到恢复接触的转变，当前双方诉求进一步明确，尽管短期出现重大变化的可能性较低，但积极的迹象在逐步显现。政策角度，逆周期托底政策和着眼长线改革政策均有看点，包括扩大对外开发、减税降费、积极财政、专项债、基建补短板等，节奏可能随经济基本面和中美贸易的边际变化改变，从而起到正向托底、平滑市场预期预期的作用。

风格角度，当前焦点在于优质核心资产超额收益能否持续，相对历史，当前核心资产估值已经并不便宜，存在一定均值回复压力；但从基本面、资金避险需求、内外资配置方向等角度，质量好、盈利能力强、估值合理的优质个股仍具有超额收益预期，且存在向“泛蓝筹”进一步扩散的可能。随着经济基本面的见底，风险偏好有望提升，投资者关注点可能从质量、盈利逐步扩散到成长、预期。行业角度，大规模刺激概率低，基建、周期行业可能基本平稳；制造业受益于转型升级、减税和托底政策，部分高端制造和汽车等可选消费品可能有一定机会；TMT 等成长板块受益于 5G 商用，行业趋势向上，但在中美贸易争端上有较大的弹性。作为量化基金，本基金将相对业绩比较基准保持相对均衡的风格和行业配置，在质量、盈利、成长、估值、预期以及市场面等选股因子上保持相对均衡的暴露，降低市场风格变幻对超额收益的影响。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关

规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，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；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。

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,118,594.98	14,117,681.82
结算备付金		360,505.37	733,087.18
存出保证金		57,143.86	48,484.65
交易性金融资产	6.4.7.2	104,154,317.22	149,345,484.71
其中：股票投资		103,961,195.52	149,345,484.71
基金投资		-	-
债券投资		193,121.70	-
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		771,846.17	1,671,794.03
应收利息	6.4.7.5	2,577.61	3,591.80
应收股利		-	-
应收申购款		10,087.48	1,781.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		116,475,072.69	165,921,906.02
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		763,074.36	1,328,376.35
应付赎回款		595,305.82	10,654.87
应付管理人报酬		138,514.55	213,716.77
应付托管费		23,085.78	35,619.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	270,907.89	102,144.67
应交税费		1.33	2.38
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	269,943.81	330,026.77
负债合计		2,060,833.54	2,020,541.28
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	110,272,064.45	195,419,876.37
未分配利润	6.4.7.10	4,142,174.70	-31,518,511.63
所有者权益合计		114,414,239.15	163,901,364.74
负债和所有者权益总计		116,475,072.69	165,921,906.02

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0376 元，基金份额总额 110,272,064.45 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		40,896,572.88	-2,517,590.59
1. 利息收入		53,452.60	1,002,285.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	53,266.32	641,077.45
债券利息收入		186.28	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	361,208.27
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填		25,573,344.91	4,304,897.80

列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.12	24,229,502.51	2,383,574.08
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收 益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,343,842.40	1,921,323.72
3. 公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.17	15,251,147.90	-8,446,343.45
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	18,627.47	621,569.34
减：二、费用		2,548,411.41	2,278,363.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,112,360.64	1,126,847.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	185,393.48	187,807.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,127,757.36	832,180.74
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.54	-
7. 其他费用	6.4.7.20	122,899.39	131,527.16
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		38,348,161.47	-4,795,953.96

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者 权益（基金净值）	195,419,876.37	-31,518,511.63	163,901,364.74
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期 利润）	-	38,348,161.47	38,348,161.47
三、本期基金份 额交易产生的基 金净值变动数	-85,147,811.92	-2,687,475.14	-87,835,287.06

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	8,996,478.99	-87,388.20	8,909,090.79
2. 基金赎回款	-94,144,290.91	-2,600,086.94	-96,744,377.85
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)	110,272,064.45	4,142,174.70	114,414,239.15
项目	上年度可比期间 2018年3月23日(基金合同生效日)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)	361,461,540.37	-	361,461,540.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,795,953.96	-4,795,953.96
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)	-152,711,761.06	-2,966,270.36	-155,678,031.42
其中：1. 基金申购款	9,493,933.67	117,878.43	9,611,812.10
2. 基金赎回款	-162,205,694.73	-3,084,148.79	-165,289,843.52
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)	208,749,779.31	-7,762,224.32	200,987,554.99

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

汇添富价值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[2017]1062号文《关于准予汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金注册的批复》准予注册,由汇添富基金管理股份有限公司于2017年12月27日至2018年3月21日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2018)验字第60466941_B17号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2018年3月23日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币361,374,896.26元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币86,644.11元,以上实收基金(本息)合计为人民币361,461,540.37元,折合361,461,540.37份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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、资产支持证券、债券回购、中小企业私募债券、同业存单、银行存款、货币市场工具、衍生工具(权证、股指期货、国债期货、股票期权等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金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。本基金的业绩比较基准为:沪深300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

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东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，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 企业所得税

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

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

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。

6.4.6.5 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。

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	11,118,594.98
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	11,118,594.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	95,774,765.55	103,961,195.52	8,186,429.97
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	185,000.00	193,121.70
	银行间市场	-	-
	合计	185,000.00	193,121.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	95,959,765.55	104,154,317.22	8,194,551.67

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：本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

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 2019年6月30日
应收活期存款利息	2,198.17
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	162.30
应收债券利息	191.21
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	0.23
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	25.70
合计	2,577.61

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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	270,907.89
银行间市场应付交易费用	-
合计	270,907.89

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.13
应付信息披露费	240,190.90

应付审计费	29,752.78
合计	269,943.81

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	195,419,876.37	195,419,876.37
本期申购	8,996,478.99	8,996,478.99
本期赎回（以“-”号填列）	-94,144,290.91	-94,144,290.91
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	110,272,064.45	110,272,064.45

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	-23,037,507.78	-8,481,003.85	-31,518,511.63
本期利润	23,097,013.57	15,251,147.90	38,348,161.47
本期基金份额交易产生的变动数	2,960,687.01	-5,648,162.15	-2,687,475.14
其中：基金申购款	-417,081.65	329,693.45	-87,388.20
基金赎回款	3,377,768.66	-5,977,855.60	-2,600,086.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,020,192.80	1,121,981.90	4,142,174.70

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	活期存款利息收入	47,824.16
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	4,851.62	
其他	590.54	
合计	53,266.32	

注：表中“其他”指直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	401,954,588.03
减：卖出股票成本总额	377,725,085.52
买卖股票差价收入	24,229,502.51

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 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

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,343,842.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,343,842.40

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	15,251,147.90
股票投资	15,243,026.20
债券投资	8,121.70
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	15,251,147.90

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	18,627.47
合计	18,627.47

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,127,757.36
银行间市场交易费用	-
合计	1,127,757.36

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	80,190.90
账户维护费	9,360.00
银行费用	3,595.71
合计	122,899.39

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年3月23日（基金合同生效日） 至2018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	717,062,310.73	100.00	611,967,034.44	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年3月23日（基金合同生效日） 至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）
东方证券股份有限公司	-	-	874,000,000.00	100.00

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 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 2019年1月1日至2019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	662,883.36	100.00	270,907.89	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2018年3月23日（基金合同生效日）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	565,526.42	100.00	565,526.42	100.00

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年3月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,112,360.64	1,126,847.51
其中：支付销售机构的客户维护费	456,615.74	500,834.57

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年3月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日
----	----------------------------	---

当期发生的基金应支付的托管费	185,393.48	187,807.96
----------------	------------	------------

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本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。

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年3月23日(基金合同生效日)至2018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
中国建设银行股份有限公司	11,118,594.98	47,824.16	19,886,743.29	88,789.46

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:本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末(2019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
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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股票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，除本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、债券投资、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产及部分应收申购款等；生息负债主要为卖出回购金融资产款。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	11,118,594.98	-	-	-	-	-	11,118,594.98
结算备付金	360,505.37	-	-	-	-	-	360,505.37
存出保证金	57,143.86	-	-	-	-	-	57,143.86
交易性金融资产	-	193,121.70	-	-	-	103,961,195.52	104,154,317.22
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	0.00
应收利息	-	-	-	-	-	2,577.61	2,577.61
应收股利	-	-	-	-	-	-	0.00
应收申购款	-	-	-	-	-	10,087.48	10,087.48
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	0.00

应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	771,846.17	771,846.17
其他 资产	-	-	-	-	-	-	0.00
资产 总计	11,536,244 .21	193,121.70	0.00	0.00	0.00	104,745,706 .78	116,475,072. 69
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	595,305.82	595,305.82
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	138,514.55	138,514.55
应付 托管 费	-	-	-	-	-	23,085.78	23,085.78
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	763,074.36	763,074.36
卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	0.00
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	0.00
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	270907.89	270,907.89
应付 税费	-	-	-	-	-	1.33	1.33
应付 利息	-	-	-	-	-	-	0.00
应付 利润	-	-	-	-	-	-	0.00
其他 负债	-	-	-	-	-	269,943.81	269,943.81
负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2,060,833.5	2,060,833.54

总计						4	
利率敏感 度缺口	11,536,244 .21	193,121.70	0.00	0.00	0.00	102,684,873 .24	114,414,239. 15
上年度末 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	14,117,681 .82	-	-	-	-	-	14,117,681.8 2
结算 备付 金	733,087.18	-	-	-	-	-	733,087.18
存出 保证 金	48,484.65	-	-	-	-	-	48,484.65
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	149,345,484 .71	149,345,484. 71
应收 利息	-	-	-	-	-	3,591.80	3,591.80
应收 申购 款	819.40	-	-	-	-	962.43	1,781.83
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	1,671,794.0 3	1,671,794.03
资产 总计	14,900,073 .05	-	-	-	-	151,021,832 .97	165,921,906. 02
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	10,654.87	10,654.87
应付	-	-	-	-	-	213,716.77	213,716.77

管理人报酬							
应付托管费						35,619.47	35,619.47
应付证券清算款						1,328,376.35	1,328,376.35
应付交易费用						102,144.67	102,144.67
应付税费						2.38	2.38
其他负债						330,026.77	330,026.77
负债总计						2,020,541.28	2,020,541.28
利率敏感度缺口	14,900,073.05					149,001,291.69	163,901,364.74

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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	103,961,195.52	90.86	149,345,484.71	91.12
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	193,121.70	0.17	-	-
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	104,154,317.22	91.03	149,345,484.71	91.12

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。		
	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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	沪深 300 指数上涨 5%	5,115,395.45	-
	沪深 300 指数下跌 5%	-5,115,395.45	-

注：于 2018 年 12 月 31 日，本基金成立未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金

资产净值的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，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	103,961,195.52	89.26
	其中：股票	103,961,195.52	89.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	193,121.70	0.17
	其中：债券	193,121.70	0.17
	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	11,479,100.35	9.86
8	其他各项资产	841,655.12	0.72
9	合计	116,475,072.69	100.00

7.2 报告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	1,744,823.00	1.53
B	采矿业	1,560,734.00	1.36
C	制造业	47,397,559.98	41.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,853,088.00	2.49
E	建筑业	3,921,253.00	3.43
F	批发和零售业	1,788,842.00	1.56
G	交通运输、仓储和邮政业	1,963,202.84	1.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,823,546.76	2.47
J	金融业	34,781,461.94	30.40

K	房地产业	4,105,556.00	3.59
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	1,021,128.00	0.89
S	综合	-	-
	合计	103,961,195.52	90.86

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	109,300	9,685,073.00	8.46
2	600519	贵州茅台	4,900	4,821,600.00	4.21
3	000333	美的集团	71,378	3,701,663.08	3.24
4	601166	兴业银行	157,700	2,884,333.00	2.52
5	600036	招商银行	71,900	2,586,962.00	2.26
6	601169	北京银行	370,600	2,190,246.00	1.91
7	600016	民生银行	327,400	2,078,990.00	1.82
8	600999	招商证券	119,000	2,033,710.00	1.78
9	000858	五粮液	16,600	1,957,970.00	1.71
10	000661	长春高新	5,700	1,926,600.00	1.68
11	000776	广发证券	139,300	1,913,982.00	1.67
12	600276	恒瑞医药	28,720	1,895,520.00	1.66
13	002475	立讯精密	72,400	1,794,796.00	1.57
14	600570	恒生电子	26,120	1,780,078.00	1.56
15	601009	南京银行	211,200	1,744,512.00	1.52
16	600031	三一重工	131,300	1,717,404.00	1.50
17	600170	上海建工	437,000	1,643,120.00	1.44
18	600025	华能水电	400,500	1,630,035.00	1.42
19	600585	海螺水泥	38,300	1,589,450.00	1.39
20	600919	江苏银行	207,200	1,504,272.00	1.31
21	600809	山西汾酒	20,300	1,401,715.00	1.23
22	600887	伊利股份	40,300	1,346,423.00	1.18
23	600398	海澜之家	140,000	1,269,800.00	1.11

24	000630	铜陵有色	513,100	1,262,226.00	1.10
25	603160	汇顶科技	9,000	1,249,200.00	1.09
26	601668	中国建筑	207,600	1,193,700.00	1.04
27	600606	绿地控股	172,000	1,174,760.00	1.03
28	000596	古井贡酒	9,700	1,149,547.00	1.00
29	000001	平安银行	82,600	1,138,228.00	0.99
30	000425	徐工机械	254,800	1,136,408.00	0.99
31	600362	江西铜业	70,700	1,112,818.00	0.97
32	002583	海能达	130,400	1,094,056.00	0.96
33	600030	中信证券	45,700	1,088,117.00	0.95
34	000338	潍柴动力	88,000	1,081,520.00	0.95
35	600271	航天信息	45,700	1,053,385.00	0.92
36	600027	华电国际	262,700	990,379.00	0.87
37	002007	华兰生物	31,400	957,386.00	0.84
38	002241	歌尔股份	107,100	952,119.00	0.83
39	600028	中国石化	171,200	936,464.00	0.82
40	002440	闰土股份	75,000	934,500.00	0.82
41	601111	中国国航	95,000	909,150.00	0.79
42	600153	建发股份	98,000	870,240.00	0.76
43	601377	兴业证券	129,100	870,134.00	0.76
44	600029	南方航空	111,600	861,552.00	0.75
45	601788	光大证券	74,200	847,364.00	0.74
46	300296	利亚德	108,000	845,640.00	0.74
47	000651	格力电器	14,900	819,500.00	0.72
48	600340	华夏幸福	23,700	771,909.00	0.67
49	600820	隧道股份	107,600	678,956.00	0.59
50	600000	浦发银行	55,500	648,240.00	0.57
51	601998	中信银行	104,400	623,268.00	0.54
52	300498	温氏股份	17,200	616,792.00	0.54
53	002714	牧原股份	10,100	593,779.00	0.52
54	000060	中金岭南	122,900	576,401.00	0.50
55	600436	片仔癀	5,000	576,000.00	0.50
56	600019	宝钢股份	87,800	570,700.00	0.50
57	603444	吉比特	2,700	566,892.00	0.50
58	002299	圣农发展	21,100	534,252.00	0.47
59	600373	中文传媒	42,400	532,544.00	0.47
60	002311	海大集团	17,100	528,390.00	0.46
61	000568	泸州老窖	6,500	525,395.00	0.46
62	601933	永辉超市	50,400	514,584.00	0.45
63	601838	成都银行	57,200	505,076.00	0.44
64	601019	山东出版	62,800	488,584.00	0.43
65	002276	万马股份	88,300	481,235.00	0.42

66	601288	农业银行	133,500	480,600.00	0.42
67	002092	中泰化学	60,000	477,600.00	0.42
68	000778	新兴铸管	104,900	465,756.00	0.41
69	002146	荣盛发展	47,700	447,903.00	0.39
70	002242	九阳股份	21,400	445,334.00	0.39
71	000166	申万宏源	86,200	431,862.00	0.38
72	000402	金融街	54,200	424,928.00	0.37
73	601601	中国太保	11,600	423,516.00	0.37
74	600438	通威股份	29,300	411,958.00	0.36
75	000002	万科A	14,700	408,807.00	0.36
76	000157	中联重科	56,300	338,363.00	0.30
77	601555	东吴证券	32,900	337,225.00	0.29
78	600104	上汽集团	13,000	331,500.00	0.29
79	600967	内蒙一机	28,700	321,440.00	0.28
80	600038	中直股份	7,800	319,956.00	0.28
81	600109	国金证券	32,900	319,788.00	0.28
82	600066	宇通客车	24,400	317,688.00	0.28
83	600566	济川药业	10,500	316,155.00	0.28
84	600329	中新药业	21,800	311,522.00	0.27
85	000830	鲁西化工	28,500	310,080.00	0.27
86	600089	特变电工	42,600	308,850.00	0.27
87	600335	国机汽车	44,200	305,864.00	0.27
88	601117	中国化学	50,400	303,408.00	0.27
89	600978	宜华生活	74,300	279,368.00	0.24
90	600466	蓝光发展	43,000	267,460.00	0.23
91	600971	恒源煤电	44,520	260,442.00	0.23
92	601198	东兴证券	21,500	255,420.00	0.22
93	603369	今世缘	8,900	248,221.00	0.22
94	600657	信达地产	57,300	236,076.00	0.21
95	000543	皖能电力	49,400	232,674.00	0.20
96	000513	丽珠集团	6,800	225,964.00	0.20
97	300059	东方财富	16,660	225,743.00	0.20
98	300003	乐普医疗	9,500	218,690.00	0.19
99	603816	顾家家居	6,500	207,480.00	0.18
100	601231	环旭电子	16,800	202,440.00	0.18
101	000069	华侨城A	29,100	202,245.00	0.18
102	002332	仙琚制药	28,300	191,308.00	0.17
103	600583	海油工程	33,900	189,840.00	0.17
104	000961	中南建设	19,800	171,468.00	0.15
105	600312	平高电气	20,800	159,952.00	0.14
106	601398	工商银行	26,600	156,674.00	0.14
107	603658	安图生物	2,100	143,556.00	0.13

108	001965	招商公路	17,100	142,443.00	0.12
109	600535	天士力	7,900	130,745.00	0.11
110	002555	三七互娱	8,100	109,755.00	0.10
111	601808	中海油服	11,100	106,893.00	0.09
112	603766	隆鑫通用	25,200	105,588.00	0.09
113	600765	中航重机	11,400	105,222.00	0.09
114	002081	金螳螂	9,900	102,069.00	0.09
115	600037	歌华有线	9,900	101,475.00	0.09
116	002221	东华能源	11,400	98,154.00	0.09
117	600968	海油发展	18,900	67,095.00	0.06
118	603967	中创物流	2,518	50,057.84	0.04
119	603915	国茂股份	1,998	46,493.46	0.04
120	603982	泉峰汽车	1,845	42,121.35	0.04
121	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.03
122	603217	元利科技	584	39,268.16	0.03
123	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.03
124	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.02
125	603863	松炆资源	806	18,602.48	0.02

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	600276	恒瑞医药	6,265,831.25	3.82
2	600036	招商银行	5,399,167.00	3.29
3	600104	上汽集团	4,613,433.00	2.81
4	601288	农业银行	4,512,434.00	2.75
5	002202	金风科技	4,454,059.82	2.72
6	600019	宝钢股份	4,436,137.00	2.71
7	601166	兴业银行	4,345,386.00	2.65
8	000333	美的集团	4,102,771.16	2.50
9	600028	中国石化	4,076,685.00	2.49
10	000651	格力电器	3,837,471.00	2.34
11	600519	贵州茅台	3,783,198.00	2.31
12	002311	海大集团	3,734,679.00	2.28
13	000858	五粮液	3,631,953.86	2.22
14	601688	华泰证券	3,309,390.39	2.02
15	601668	中国建筑	3,289,639.40	2.01
16	000001	平安银行	3,280,700.00	2.00
17	002415	海康威视	3,262,670.68	1.99
18	600016	民生银行	3,256,430.00	1.99
19	600919	江苏银行	3,215,636.00	1.96

20	600309	万华化学	3,126,931.92	1.91
----	--------	------	--------------	------

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	000651	格力电器	8,120,075.00	4.95
2	601328	交通银行	6,928,673.00	4.23
3	600276	恒瑞医药	6,537,858.46	3.99
4	600887	伊利股份	5,660,568.00	3.45
5	600036	招商银行	5,440,260.00	3.32
6	002202	金风科技	5,135,067.15	3.13
7	601601	中国太保	4,789,557.72	2.92
8	600028	中国石化	4,755,743.00	2.90
9	601398	工商银行	4,684,574.00	2.86
10	601688	华泰证券	4,480,703.00	2.73
11	601288	农业银行	4,410,200.00	2.69
12	601318	中国平安	4,235,114.34	2.58
13	601818	光大银行	4,050,127.00	2.47
14	002081	金螳螂	4,044,685.64	2.47
15	600104	上汽集团	3,987,703.00	2.43
16	601006	大秦铁路	3,965,895.00	2.42
17	601211	国泰君安	3,848,029.00	2.35
18	600019	宝钢股份	3,722,841.57	2.27
19	601877	正泰电器	3,703,308.01	2.26
20	600031	三一重工	3,680,931.69	2.25
21	600309	万华化学	3,632,102.00	2.22
22	600886	国投电力	3,601,724.09	2.20
23	601009	南京银行	3,560,770.00	2.17
24	002146	荣盛发展	3,560,504.65	2.17
25	002415	海康威视	3,518,837.70	2.15
26	601607	上海医药	3,513,528.00	2.14
27	000895	双汇发展	3,505,964.39	2.14
28	601988	中国银行	3,362,421.70	2.05

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	317,097,770.13
卖出股票收入(成交)总额	401,954,588.03

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	193,121.70	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	193,121.70	0.17

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110051	中天转债	1,640	172,396.80	0.15
2	110056	亨通转债	210	20,724.90	0.02

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：本基金本报告期内未投资国债期货。

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。

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	57,143.86
2	应收证券清算款	771,846.17
3	应收股利	-
4	应收利息	2,577.61
5	应收申购款	10,087.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	841,655.12

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 (%)
1,998	55,191.22	0.00	0.00	110,272,064.45	100.00

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	55,294.83	0.05

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（2018 年 3 月 23 日） 基金份额总额	361,461,540.37
本报告期期初基金份额总额	195,419,876.37
本报告期基金总申购份额	8,996,478.99
减：本报告期基金总赎回份额	94,144,290.91
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	110,272,064.45

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

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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，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。

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	717,062,310.73	100.00%	662,883.36	100.00%	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-

申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

(1) 基金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 2018 年资产净值的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-01-01
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下 115 只基金 2018 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, 证券日报	2019-01-21
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大智慧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	2019-01-26
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加前海财厚为代销机构并参与费率优惠活动的公告	证券时报, 公司网站	2019-03-22
5	汇添富基金旗下 115 只基金 2018 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, 证券日报	2019-03-26
6	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公告	中证报, 公司网站	2019-04-02
7	汇添富基金旗下 123 只基金 2019 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, 证券日报	2019-04-20
8	汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金更新招募说明书(2019 年第 1 号)	上证报, 公司网站	2019-04-27
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加西部证券为代销机构的公告	上证报, 公司网站	2019-06-22

§ 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价值多因子量化策略股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富价值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、报告期内汇添富价值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 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 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 8 月 29 日