汇添富医药保健混合型证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3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
报告送出日期:2019年4月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富医药保健混合
基金主代码	470006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月21日
报告期末基金份额总额	1,660,014,989.68份
投资目标	本基金采用自下而上的投资方法,精选医药保健行业的优质上市公司,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险;个股精选策略用于挖掘医药保健行业中具有长期持续增长模式、估值水平相对合理的优质上市公司。
业绩比较基准	中证医药卫生指数 × 80% + 上证国债指数 × 20%
风险收益特征	本基金是混合型基金,本基金的风险和预期收益比较均衡,在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	-23,067,794.38
2.本期利润	544,482,661.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.2808
4.期末基金资产净值	2,245,495,641.59
5.期末基金份额净值	1.353

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	27.28%	1.52%	23.48%	1.43%	3.80%	0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2010年9月21日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周蓉	汇添富医药保健混合基金的基金经理、医药行业投资总监。	2012年3月2日	-	12年	国籍:中国,学历:上海交通大学工商管理硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格,从业经历:曾任海通证券研究所医药行业研究员,2009年9月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任医药行业投资总监,2012年3月2日至今任汇添富医药保健混合基金的基金经理。

注:1.,基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期;
2.非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;
3.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

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,基金管理人对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2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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年一季度,在货本市场新定位、金融去杠杆暂时告一段落的双重利好下,市场风险偏好上升,迎来大幅反弹,医药股元旦后受政策影响创新低后便启动了反弹行情,热点纷呈,创新药相关公司、医药消费升级以及工业大家等相关股票表现较好。第一季度,沪深300指数累计上涨了28.62%,中证医药指数上涨了29.03%,医药板块略强于大盘。一季度我们减持了未来可能受行业政策影响大的股票,加大了对医保政策依赖较小的公司配置,特别是创新药浪潮中的服务类公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

第一季度本基金收益率为27.28%,业绩比较基准收益率为23.48%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,859,761,983.01	80.42
	其中:股票	1,859,761,983.01	80.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,960,251.60	0.08
	其中:债券	1,960,251.60	0.08
	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	422,623,796.64	18.28
8	其他资产	28,180,412.70	1.22
9	合计	2,312,526,443.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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	1,402,781,696.84	62.47
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	157,135,354.22	7.00
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	42,713,051.67	1.90
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,007,895.46	1.43
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	225,123,984.82	10.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,859,761,983.01	82.82

5.2.2 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投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600763	通策医疗	1,887,351	133,072,345.50	5.93
2	002422	科伦药业	4,491,531	130,029,822.45	5.79
3	000661	长春高新	381,609	120,966,236.91	5.39
4	603707	健友股份	3,081,028	112,395,901.44	5.01
5	600276	恒瑞医药	1,500,466	98,160,485.72	4.37
6	002007	华兰生物	2,070,585	93,176,325.00	4.15
7	603939	益丰药房	1,412,116	81,930,970.32	3.65
8	600436	片仔癀	614,551	70,611,909.90	3.14
9	002044	美年健康	3,584,078	66,628,010.02	2.97
10	300003	乐普医疗	2,300,000	60,950,000.00	2.71

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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)	1,960,251.60	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,960,251.60	0.09

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	123021	万信转2	16,545	1,960,251.60	0.09

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,244,391.07
2	应收证券清算款	21,628,531.95
3	应收股利	-
4	应收利息	71,460.06
5	应收申购款	5,236,029.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,180,412.70

5.11.4 报告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转股期的债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,105,196,848.83
报告期期间基金总申购份额	113,417,715.44
减:报告期期间基金总赎回份额	558,599,574.59
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,660,014,989.68

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准汇添富医药保健股票型证券投资基金募集的文件;
2.《汇添富医药保健混合型证券投资基金基金合同》;
3.《汇添富医药保健混合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.报告期内汇添富医药保健混合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。

9.2 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

9.3 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4月20日

汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	添富鑫永定开债
基金主代码	005590
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年1月25日
报告期末基金份额总额	5,430,639,148.55份
投资目标	在科学严格管理风险的前提下,本基金力争创造超越业绩比较基准的较高收益。
投资策略	本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征,分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势,且上而下决定类属资产配置及组合久期;并依据内部信用评级系统,深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略等,在谨慎投资的基础上,力争实现组合的稳健增值。
业绩比较基准	中债综合指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	添富鑫永定开债A	添富鑫永定开债C
下属分级基金的交易代码	005590	005591
报告期末下属分级基金的份额总额	5,430,639,148.55份	0.00份

注:本基金C类份额为0。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
	添富鑫永定开债A	添富鑫永定开债C
1.本期已实现收益	67,942,424.03	-
2.本期利润	97,277,010.63	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0179	-
4.期末基金资产净值	5,697,459,097.94	-
5.期末基金份额净值	1.0491	-

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.本基金C类份额为0。

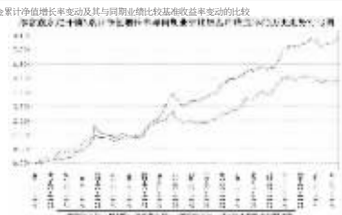
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
	添富鑫永定开债A					
过去三个月	1.74%	0.07%	0.47%	0.05%	1.27%	0.02%

注:本基金C类份额为0。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2018年1月25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。
本基金C类份额为0。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴江宏	汇添富可转换债券基金、汇添富益安保本混合基金、汇添富益稳保本混合基金、汇添富鑫利定开债、汇添富鑫利定开债A、汇添富鑫利定开债C、汇添富鑫利定开债A、汇添富鑫利定开债C、汇添富益定开债、汇添富鑫定开债、汇添富鑫稳定开债、汇添富鑫利定期开放债券基金(原汇添富鑫利定期开放债券基金)的基金经理。	2018年1月25日	-	8年	国籍:中国,学历:厦门大学经济学硕士,2011年加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益分析师。2015年7月17日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理,2016年4月19日至今任汇添富安保本混合基金的基金经理,2016年8月3日至今任汇添富益稳保本混合基金的基金经理,2016年9月29日至今任汇添富鑫利债券基金(原汇添富鑫利债券基金)的基金经理,2017年3月13日至今任汇添富鑫利定开债基金(原汇添富鑫利定开债基金)的基金经理,2017年4月20日至今任汇添富益定开债基金的基金经理,2017年4月21日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理,2017年6月21日至今任汇添富鑫稳定开债基金的基金经理,2018年1月25日至今任汇添富鑫永定开债基金的基金经理,2018年4月16日至今任汇添富鑫稳定开债基金的基金经理,2018年9月28日至今任汇添富年年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。

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 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

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,基金管理人对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2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 报告期内基金投资策略和运作分析

基本面,一季度社融数据转暖,显示宏信用政策或逐步生效,制造业投资增速下滑,但基建发力,地产投资有韧性,带动固定资产投资增速同比改善。不过需求仍然不佳,社零表现疲软,外贸开局均不佳,政策面,政策托底经济态度明显,央行货币政策保持宽松,同时更强调逆周期调节和结构性货币政策规模小幅、民营企业融资倾斜。

一季度,1年国债收益率下行16bp至2.44%,10年国债收益率下行16bp至3.07%;信用债利率普遍下行,尤其是在宽信用政策的加持下,低评级信用债收益率下行幅度显著大于高等级,等级利差大幅压缩。

报告期内,组合主要配置1-3年高等级信用债,杠杆水平和久期均有所降低。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富鑫永定开债A基金份额净值为1.0491元,本报告期基金份额净值增长率为1.74%;同期业绩比较基准收益率为0.47%。本基金C类份额为0。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,188,369,826.00	96.66
	其中:债券	8,068,369,826.00	95.24
	资产支持证券	120,000,000.00	1.42
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	147,731,150.18	1.74
8	其他资产	135,331,614.97	1.60
9	合计	8,471,432,591.15	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.2.2 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投资股票投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	677,248,000.00	11.89
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,116,990,826.00	89.81
5	企业短期融资券	1,174,775,000.00	20.62
6	中期票据	173,261,000.00	3.04
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	926,095,000.00	16.25
9	其他	-	-
10	合计	8,068,369,826.00	141.61

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	111910058	19兴业银行CD058	2,000,000	195,760,000.00	3.44
2	136292	16中星01	1,900,000	192,014,000.00	3.37
3	011802043	18印电股SCP004	1,600,000	160,800,000.00	2.82
4	143712	18招商G5	1,500,000	153,015,000.00	2.69
5	143229	17国君G1	1,500,000	152,475,000.00	2.68

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	139284	联易融08	400,000	40,000,000.00	0.70
2	139415	万科30A1	300,000	30,000,000.00	0.53
3	139303	联易融09	300,000	30,000,000.00	0.53
4	139318	万科31A1	200,000	20,000,000.00	0.35

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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持有股指期货交易情况说明。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货交易情况说明。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资前十大证券中的17国信01(112516.SZ)的发行人国信证券股份有限公司于2018年6月21日收到中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《行政处罚决定书》(处罚字[2018]46号),我司经研究评估,上述事件对公司经营活动业绩并不产生重大的实质影响,对其投资价值也没有实质影响。本基金持有该债券经过合理的投资决策审批。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	495,939.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	134,835,675.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	135,331,614.97

5.11.4 报告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可转换债券投资。

5.11.5 报告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不存在流通受限股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	5,430,639,148.55
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	5,430,639,148.55

注:总申购份额含红利再投份额。
本基金C类份额为0。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

	添富鑫永定开债A	添富鑫永定开债C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金份额比例(%)	0.18	-

注:1.其中“买入/申购”含红利再投份额。
2.本基金于2018年1月25日成立,本公司于2018年1月22日用固有资金10,001,000.00元认购本基金份额10,000,000.00份,认购费用1,000.00元,符合招募说明书规定的认购费率。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.18	10,000,000.00	0.18	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.18	10,000,000.00	0.18	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	2019年1月1日至2019年3月31日	5,420,639,148.55	-	-	5,420,639,148.55	99.82
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品持有风险

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.提前终止基金问的风险
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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1.中国证监会批准汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件;
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》;
3.《汇添富鑫永定期开放债券型发起式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.报告期内汇添富鑫永定期开放债券型发起式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。

10.2 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

10.3 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4月20日

汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金
基金主代码	002420
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年3月19日
报告期末基金份额总额	407,367,675.14份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过积极主动的资产配置,充分挖掘各大类资产投资机会,力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金综合分析影响债券市场的宏观、政策面、市场面等多方面因素(其中,基本面因素包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、固定资产投资总量、发电量等宏观经济统计数据;政策面因素包括存款准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等货币政策、政府财政总量、转移支付水平以及税收政策等政策面;市场面因素包括市场参与者情绪、市场资金供求变化、市场PMI等市场平均水平的偏离程度等),结合全球宏观经济形势、研判国内外经济的发展趋势,并在严格控制投资组合风险的前提下,对投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种进行战略配置和动态调整,以规避或分散市场风险,力争实现基金资产的中长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+中债综合指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
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

2.1 基金基本情况(转型后)	
基金简称	汇添富盈鑫保本混合
基金主代码	002420
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月11日
报告期末基金份额总额	509,816,875.73份
投资目标	本基金主要通过投资组合保险技术来运作,在保证本金安全的前提下,力争在保本期内实现基金财产的稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合,利用组合保险技术,动态调整安全资产与风险资产的投资比例,以确保基金在保本周期到期时,实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税后)。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。
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