汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9月30日

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26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2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富安鑫智选混合
交易代码	001796
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月26日
报告期末基金份额总额	349,030,690.06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	本基金综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素,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、货币市场工具和证券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*50%+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,属于中高收益风险特征的基金。
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
下属分级基金的基金简称	汇添富安鑫智选混合A / 汇添富安鑫智选混合C
下属分级基金的交易代码	001796 / 002158
报告期末下属分级基金的份额总额	347,276,860.94份 / 1,753,829.12份

§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(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	汇添富安鑫智选混合A	汇添富安鑫智选混合C
1. 本期已实现收益	-10,331,900.11	-60,001.75
2. 本期利润	-8,654,250.38	-69,099.64
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0249	-0.0396
4. 期末基金资产净值	383,608,286.12	2,032,884.87
5. 期末基金份额净值	1.105	1.159

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

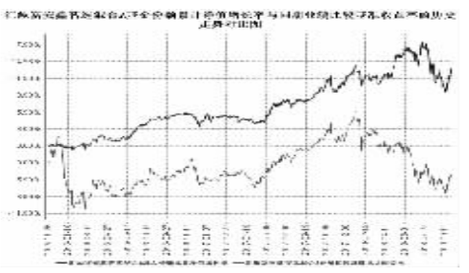
汇添富安鑫智选混合A

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	-2.21%	0.64%	-0.74%	0.67%	-1.47%	-0.03%

汇添富安鑫智选混合C

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	-2.19%	0.64%	-0.74%	0.67%	-1.45%	-0.03%

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(2015年11月26日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(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		
曾刚	汇添富多元收益、可转换债券、汇业债债券、双利增强债券、汇添富安鑫智选混合、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富6月红定期开放债券基金、汇添富盈安保本混合基金、汇添富盈稳保本混合基金、汇添富鑫隆保本混合基金、汇添富长添利定期开放债券基金、汇添富长添利定期开放债券基金、汇添富主要消费ETF联接基金、汇添富中证精准医药基金、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)、汇添富价值多因子股票的基金经理,指数与量化投资部副总监。	2015年11月26日	-	17年	国籍:中国,学历:中国科技大学学士,清华大学MBA,业务资格:基金从业资格,从业经历:2008年5月15日至2010年2月5日任华富货币基金的基金经理,2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强基金的基金经理,2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报基金的基金经理,2011年11月加入汇添富基金,现任固定收益投资副总监,2012年5月9日至2014年1月21日任汇添富理财30天基金的基金经理,2012年6月12日至2014年1月21日任汇添富理财60天基金的基金经理,2012年9月18日至今任汇添富多元收益基金的基金经理,2012年10月18日至2014年9月17日任汇添富理财28天基金的基金经理,2013年1月24日至2015年3月31日任汇添富理财21天基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理,2013年5月29日至2015年3月31日任汇添富理财7天基金的基金经理,2013年6月14日至今任汇添富定金债基金的基金经理,2013年9月12日至2015年3月31日任汇添富现金宝货币基金的基金经理,2013年12月3日至今任汇添富双利增强债券基金的基金经理,2015年11月26日至今任汇添富安鑫智选混合基金的基金经理,2016年2月17日至今任汇添富6月红定期开放债券基金的基金经理,2016年3月16日至今任汇添富稳健添利定期开放债券基金的基金经理,2016年4月19日至今任汇添富盈安保本混合基金的基金经理,2016年8月3日至今任汇添富盈稳保本混合基金的基金经理,2016年12月6日至今任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理,2017年5月15日至今任汇添富鑫隆保本混合基金的基金经理,2018年2月11日至今任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理,2018年7月6日至今任汇添富达欣混合基金的基金经理。
郑慧莲	汇添富双利增强债券、汇添富双利债券、汇添富年年丰定开混合、汇添富年年泰定开混合、汇添富6月红定期开放债券、汇添富多元收益债券、汇添富年年益定开混合、汇添富稳和混合、汇添富安鑫智选混合、汇添富达欣混合、汇添富全球消费混合(QDII)的基金经理。	2018年4月2日	-	8年	国籍:中国,学历:复旦大学会计学硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格,中国注册会计师,从业经历:2010年7月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任行业研究员、高级研究员,2017年5月18日至2017年12月11日任汇添富年年丰定开混合基金和汇添富6月红定开债基金的基金经理助理,2017年5月18日至2017年12月25日任汇添富年年益定开混合基金的基金经理助理,2017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日至今任汇添富价值多因子股票的基金经理,2016年4月19日至今任汇添富全球消费混合(QDII)的基金经理。

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

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

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 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3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

三季度,宏观经济数据维持弱势,投资增速缓慢下行,制造业、基建与房地产投资总体均无亮点,消费维持弱势,消费升级与降级并存,考虑到捡跑因素之后进出口数据也面临一定困难,实体企业盈利能力与此同时三季度原油因美伊冲突持续上涨,风灾水灾猪瘟等事件带动CPI略上行,尽管是几项短期因素,但一定程度上仍然引发了"滞涨"的扰动,对未来通胀产生一些分歧。三季度,央行政策保持相对宽松,7月份定向降准支持债转股,融资便利且利率处于低位,在中美贸易摩擦仍缠绕的情况下,从资产配置上债仍优于股;信用违约事件多于二季度,带动信用利差继续分化,从市场表现看,利率债总体平稳,国开略下行,地方政府债受欢迎,高评级信用债小幅下行,低评级成交仍不活跃。

股票市场在估值底部开始以震荡为主,反弹的认可度提高但力度不大,银行石化钢铁等大盘行业对指数贡献较大,进出口比例较高的纺织服装、轻工制造等跌幅较明显。主板小幅下跌1-2%,但中小创跌幅均超10%。

可转债三季度表现一般,7月份银行、钢铁转债等上涨抬升了转债指数,8、9月份则总体表现胶着,阴跌为主,成交量不大;部分债性转债开始得到关注。

本组合三季度净值下跌2.2%,本期组合的纯债维持中性比例配置,保持了较好的流动性,可转债参与新券申购,权益部分仓位较高,本季度市场风格出现变化,净值暂时受损。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富安鑫智选混合A基金份额净值为1.105元,本报告期基金份额净值增长率为-2.21%;截至本报告期末汇添富安鑫智选混合C基金份额净值为1.159元,本报告期基金份额净值增长率为-2.19%;同期业绩比较基准收益率为-0.74%。

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	109,625,452.18	28.13
	其中:股票	109,625,452.18	28.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	206,054,875.40	52.87
	其中:债券	206,054,875.40	52.87
	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	63,000,000.00	16.17
	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	7,788,827.64	2.00
8	其他资产	3,252,964.37	0.83
9	合计	389,722,119.59	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	84,546,109.53	21.92
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	930,690.00	0.24
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,433,051.58	2.19
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	1,284,651.57	0.33
R	文化、体育和娱乐业	14,430,949.50	3.74
S	综合	-	-
	合计	109,625,452.18	28.43

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组合。

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	600104	上汽集团	486,846	16,202,234.88	4.20
2	000651	格力电器	393,745	15,828,549.00	4.10
3	300144	宋城演艺	648,582	14,430,949.50	3.74
4	600872	中炬高新	328,500	10,709,100.00	2.78
5	002304	洋河股份	82,100	10,508,800.00	2.73
6	002507	涪陵榨菜	417,237	10,336,898.85	2.68
7	601888	中国国旅	123,979	8,433,051.58	2.19
8	600887	伊利股份	256,928	6,597,911.04	1.71
9	603589	口子窖	84,909	4,372,813.50	1.13
10	600519	贵州茅台	5,596	4,085,080.00	1.06

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	20,088,000.00	5.21
	其中:政策性金融债	20,088,000.00	5.21
4	企业债券	175,352,000.00	45.47
5	企业短期融资券	10,095,000.00	2.62
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	519,875.40	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	206,054,875.40	53.43

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(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	136401	16平润01	300,000	29,343,000.00	7.61
2	127445	16金江02	300,000	29,070,000.00	7.54
3	136776	16国航02	300,000	28,938,000.00	7.50
4	180201	18国开01	200,000	20,088,000.00	5.21
5	143010	17阳信01	200,000	20,068,000.00	5.20

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:报告期末本基金无股指期货持仓。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	224,927.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,011,168.41
5	应收申购款	16,868.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,252,964.37

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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002507	涪陵榨菜	10,213,500.00	2.65	大宗交易受限

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富安鑫智选混合A	汇添富安鑫智选混合C
报告期期初基金份额总额	347,244,071.08	1,250,049.20
报告期期间基金总申购份额	49,590.22	1,497,964.22
减:报告期期间基金总赎回份额	16,800.36	994,184.30
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	347,276,860.94	1,753,829.12

注:总申购份额含红利再投份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本基金本报告期末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

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	2018年7月1日至2018年9月30日	277,519,888.99	0.00	0.00	277,519,888.99	79.51%

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。

§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安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2.《汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《汇添富安鑫智选灵活配置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.报告期内汇添富安鑫智选灵活配置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
2018年10月26日

汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9月30日

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26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2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富成长多因子量化策略股票
交易代码	001050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月16日
报告期末基金份额总额	1,102,890,932.00份
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	本基金主要投资于或长期行业的股票,采用基金管理人的金融工程团队开发的多因子量化策略进行选股。
业绩比较基准	中证500指数收益率×90%+活期存款利率(税后)×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的基金产品。
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(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-130,928,469.49
2.本期利润	-76,756,517.67
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0689
4.期末基金资产净值	1,072,048,451.82
5.期末基金份额净值	0.972

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。

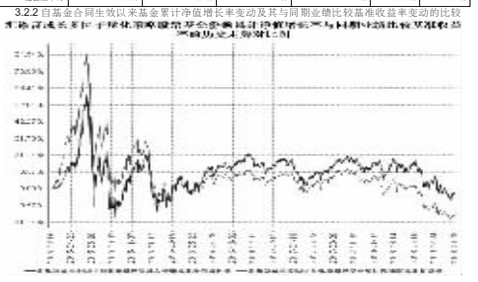
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-6.72%	1.31%	-7.17%	1.17%	0.45%	0.14%

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(2015年2月16日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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		
李怀宝	汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富纯债(LOF)基金、汇添富达欣混合基金、汇添富盈盈保本混合基金、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富长添利定期开放债券基金、汇添富鑫隆保本混合基金、汇添富鑫隆债券基金、汇添富年年泰定开混合基金、汇添富春丰混合基金、汇添富鑫泽定开债基金的基金经理、汇添富增强收益债券基金的基金经理助理。	2015年12月2日	2018年7月6日	11年	国籍:中国,学历:复旦大学经济学博士,相关业务资格:基金从业资格,从业经历:曾任光大证券股份有限公司研究所债券分析师,国信证券股份有限公司经济研究所固定收益高级分析师,2012年5月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任固定收益高级分析师,2015年5月25日至2018年8月2日任汇添富增强收益债券基金的基金经理助理,2015年11月18日至2018年8月2日任汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富纯债(LOF)基金(原汇添富互利分级债券基金)的基金经理,2015年12月2日至2018年7月6日任汇添富达欣混合基金的基金经理,2016年3月11日至2018年8月2日任汇添富盈盈保本混合基金的基金经理,2016年3月16日至2018年8月2日任汇添富稳健添利定期开放债券基金的基金经理,2016年12月6日至2018年8月2日任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理,2016年12月26日至2018年8月2日任汇添富鑫隆债券基金的基金经理,2017年4月14日至2018年8月2日任汇添富年年泰定开混合基金的基金经理,2017年9月29日至2018年8月2日任汇添富春丰混合基金的基金经理,2018年3月8日至2018年8月2日任汇添富鑫泽定开债基金的基金经理。
世刚	汇添富多元收益、可转换债券、主业债债券、双利增强债券、汇添富安鑫智选混合、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富6月红定期开放债券基金、汇添富盈安保本混合基金、汇添富盈稳保本混合基金、汇添富鑫隆保本混合基金、汇添富鑫隆债券基金、汇添富长添利定期开放债券基金、汇添富年年益定开混合基金、汇添富稳和混合基金、汇添富达欣混合基金的基金经理,现任固定收益投资副总监。	2018年7月6日	-	17年	国籍:中国,学历:中国科技大学学士,清华大学MBA,业务资格:基金从业资格,从业经历:2008年5月15日至2010年2月5日任华富货币基金的基金经理,2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强基金的基金经理,2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报基金的基金经理,2011年11月加入汇添富基金,现任固定收益投资副总监,2012年5月9日至2014年1月21日任汇添富理财30天基金的基金经理,2012年6月12日至2014年1月21日任汇添富理财60天基金的基金经理,2012年9月18日至今任汇添富多元收益基金的基金经理,2012年10月18日至2014年9月17日任汇添富理财28天基金的基金经理,2013年1月24日至2015年3月31日任汇添富理财21天基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理,2013年5月29日至2015年3月31日任汇添富理财7天基金的基金经理,2013年6月14日至今任汇添富定金债基金的基金经理,2013年9月12日至2015年3月31日任汇添富现金宝货币基金的基金经理,2013年12月3日至今任汇添富双利增强债券基金的基金经理,2015年11月26日至今任汇添富安鑫智选混合基金的基金经理,2016年2月17日至今任汇添富6月红定期开放债券基金的基金经理,2016年3月16日至今任汇添富稳健添利定期开放债券基金的基金经理,2016年4月19日至今任汇添富盈安保本混合基金的基金经理,2016年8月3日至今任汇添富盈稳保本混合基金的基金经理,2016年9月29日至今任汇添富保鑫隆保本混合基金的基金经理,2016年12月6日至今任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理,2017年5月15日至今任汇添富鑫隆保本混合基金的基金经理,2018年2月11日至今任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理,2018年7月6日至今任汇添富达欣混合基金的基金经理。
郑慧莲	汇添富双利增强债券、汇添富双利债券、汇添富年年丰定开混合、汇添富年年泰定开混合、汇添富6月红定期开放债券、汇添富多元收益债券、汇添富年年益定开混合、汇添富稳和混合、汇添富安鑫智选混合、汇添富达欣混合、汇添富全球消费混合(QDII)的基金经理。	2018年7月6日	-	8年	国籍:中国,学历:复旦大学会计学硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格,中国注册会计师,从业经历:2010年7月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任行业研究员、高级研究员,2017年5月18日至2017年12月11日任汇添富年年丰定开混合基金和汇添富6月红定开债基金的基金经理助理,2017年5月18日至2017年12月25日任汇添富年年益定开混合基金的基金经理助理,2017年12月12日至今任汇添富双利增强债券、汇添富双利债券、汇添富年年丰定开混合、汇添富年年泰定开混合、汇添富6月红定期开放债券的基金经理,2017年12月26日至今任汇添富多元收益债券、汇添富年年益定开混合的基金经理,2018年3月1日至今担任汇添富稳和混合的基金经理,2018年4月2日至今任汇添富安鑫智选混合的基金经理,2018年7月6日至今任汇添富达欣混合的基金经理,2018年9月21日至今任汇添富全球消费混合(QDII)的基金经理。

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

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

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 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3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

三季度,宏观经济数据维持弱势,投资增速缓慢下行,制造业、基建与房地产投资总体均无亮点,消费维持弱势,消费升级与降级并存,考虑到捡跑因素之后进出口数据也面临一定困难,实体企业盈利能力与此同时三季度原油因美伊冲突持续上涨,风灾水灾猪瘟等事件带动CPI略上行,尽管是几项短期因素,但一定程度上仍然引发了"滞涨"的扰动,对未来通胀产生一些分歧。三季度,央行政策保持相对宽松,7月份定向降准支持债转股,融资便利且利率处于低位,在中美贸易摩擦仍缠绕的情况下,从资产配置上债仍优于股;信用违约事件多于二季度,带动信用利差继续分化,从市场表现看,利率债总体平稳,国开略下行,地方政府债受欢迎,高评级信用债小幅下行,低评级成交仍不活跃。

股票市场在估值底部开始以震荡为主,反弹的认可度提高但力度不大,银行石化钢铁等大盘行业对指数贡献较大,进出口比例较高的纺织服装、轻工制造等跌幅较明显。主板小幅下跌1-2%,但中小创跌幅均超10%。

可转债三季度表现一般,7月份银行、钢铁转债等上涨抬升了转债指数,8、9月份则总体表现胶着,阴跌为主,成交量不大;部分债性转债开始得到关注。

本组合三季度净值上涨0.56%,本期组合的纯债维持较高的比例配置,,可转债保持中性仓位,权益部分有限控制了仓位,但本季度市场风格出现变化,权益部分略有拖累,总体回报为正。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金A基金份额净值为1.078元,本报告期基金份额净值增长率为0.56%;截至本报告期末汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金C基金份额净值为1.066元,本报告期基金份额净值增长率为0.38%;同期业绩比较基准收益率为-0.74%。

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	947,905.00	0.09
B	采矿业	62,888,960.00	5.87
C	制造业	582,862,404.29	54.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,128,890.00	3.18
E	建筑业	22,185,146.20	2.07
F	批发和零售业	63,034,097.10	5.88
G	交通运输、仓储和邮政业	18,297,436.00	1.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,324,165.86	4.13
J	金融业	5,249,503.21	0.49
K	房地产业	56,954,176.40	5.31
L	租赁和商务服务业	24,882,343.00	2.32
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,262,101.00	1.14
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	41,807,764.00	3.90
S	综合	-	-
	合计	969,824,892.06	90.46

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组合。

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	300182	捷成股份	3,253,700	18,350,868.00	1.71
2	600867	通化东宝	1,004,680	18,224,895.20	1.70
3	600688	上海石化	3,109,000	18,218,740.00	1.70
4	000778	新兴铸管