

汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

Table with 2 columns: 行业名称, 公允价值(人民币), 占基金资产净值比例(%)

(注:以上分类采用基金产品分类标准(CCS))

53 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

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

54 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债券投资明细

Table with 6 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

55 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

56 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贵金属投资明细

57 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

58 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

59 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

60 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

61 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

62 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

63 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

64 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

65 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

66 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

67 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

68 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

69 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

70 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

71 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

72 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

73 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

74 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

75 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

76 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

77 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

78 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

79 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

80 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

81 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

82 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

83 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

84 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

85 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

86 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

87 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

88 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

89 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

90 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

91 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

92 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

93 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

94 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

95 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

96 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

97 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

98 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

99 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

100 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

101 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

102 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

103 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

104 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

105 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

106 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

107 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

108 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

109 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

110 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

111 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

112 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

113 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

114 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

115 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

116 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

117 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

118 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

119 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

120 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

121 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

122 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

123 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

124 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

125 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

126 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

127 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

128 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

129 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

130 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

汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

4.1 基金管理人(或基金托管人)简介

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

报告送出日期: 2018年10月26日

4.2 基金管理人报告

报告期内, 基金管理人恪守诚信, 勤勉尽责, 恪遵职业道德, 严格执行法律法规, 切实履行受托人义务, 为基金份额持有人谋求最大利益, 实现基金资产的保值增值。

报告期内, 基金管理人严格执行公平交易制度, 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、集中公平交易执行、交易严密监控和报告及分析等环节在内的公平交易各环节执行情况良好。

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, 基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3 异常交易行为的专项说明

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超过证券当日总成交量 2% 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形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年三季度, 全球经济保持复苏态势, 美联储在经济持续向好的背景下, 加快了加息和缩表的节奏, 叠加新兴市场的摩擦, 特别是国际贸易之间的争端, 导致了美元持续走强, 资金从新兴市场撤离, 转入美国等成熟市场。

在三季度中后期, 由于美国对伊朗的军事施压, 推高原油价格大涨, 导致市场对通胀预期的担忧, 风险偏好快速回升, 资源和公共事业等行业表现较好。总体而言, 港股市场整体偏弱, 医药、科技、消费类标的表现突出。

本季度, 受到美国加息超预期、中美贸易摩擦、债务违约担忧、美元走强、人民币贬值等因素影响, 新兴市场受到了比较明显的资金流出, 其中, 最主要的因素是, 美国加息超预期进一步加快, 导致美债持续加息, 资金流出, 影响了全球的风险偏好和资金流向, 在此背景下, 港股的资金流出, 导致了港股的表现较弱。行业政策的变化, 叠加医药行业的政策, 导致医药股等表现弱于大盘。

本基金在三季度保持持仓结构不变, 重仓核心继续保持在弱经济周期、景气度持续上升的行业, 从中挑选并重仓优秀标的。

4.5 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 110 元; 本报告基金份额净值增长率为 -12%, 业绩比较基准收益率为 -10%。

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

Table with 3 columns: 序号, 投资组合, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

注: 本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 250,062,237.67 元, 占期末净值比例 80.2%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金总资产比例(%)

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

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值(元), 占基金总资产比例(%)

注: 本基金本报告期末持有资产支持证券。

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投资。

5.9 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投资。

6. 基金资产净值及基金份额净值

截至本报告期末, 本基金资产净值为 110 元, 基金份额净值为 1.10 元。

7. 基金管理人承诺

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, 也不保证基金资产净值不受损失。

8. 基金托管人承诺

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证基金资产净值不受损失。

9. 基金销售机构

基金销售机构: 汇添富基金管理股份有限公司

10. 基金管理人联系方式

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

11. 基金管理人网址

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

12. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

13. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

14. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

15. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

16. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

17. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

18. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

19. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

20. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

21. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

22. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

23. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

24. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

25. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

26. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

27. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

28. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

29. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

30. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

31. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

32. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

33. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

汇添富沪港深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

2018年第三季度报告

4.1 基金管理人(或基金托管人)简介

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

报告送出日期: 2018年10月26日

4.2 基金管理人报告

报告期内, 基金管理人恪守诚信, 勤勉尽责, 恪遵职业道德, 严格执行法律法规, 切实履行受托人义务, 为基金份额持有人谋求最大利益, 实现基金资产的保值增值。

报告期内, 基金管理人严格执行公平交易制度, 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、集中公平交易执行、交易严密监控和报告及分析等环节在内的公平交易各环节执行情况良好。

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, 基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3 异常交易行为的专项说明

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超过证券当日总成交量 2% 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形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年三季度, 全球经济保持复苏态势, 美联储在经济持续向好的背景下, 加快了加息和缩表的节奏, 叠加新兴市场的摩擦, 特别是国际贸易之间的争端, 导致了美元持续走强, 资金从新兴市场撤离, 转入美国等成熟市场。

在三季度中后期, 由于美国对伊朗的军事施压, 推高原油价格大涨, 导致市场对通胀预期的担忧, 风险偏好快速回升, 资源和公共事业等行业表现较好。总体而言, 港股市场整体偏弱, 医药、科技、消费类标的表现突出。

本季度, 受到美国加息超预期、中美贸易摩擦、债务违约担忧、美元走强、人民币贬值等因素影响, 新兴市场受到了比较明显的资金流出, 其中, 最主要的因素是, 美国加息超预期进一步加快, 导致美债持续加息, 资金流出, 影响了全球的风险偏好和资金流向, 在此背景下, 港股的资金流出, 导致了港股的表现较弱。行业政策的变化, 叠加医药行业的政策, 导致医药股等表现弱于大盘。

本基金在三季度保持持仓结构不变, 重仓核心继续保持在弱经济周期、景气度持续上升的行业, 从中挑选并重仓优秀标的。

4.5 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 110 元; 本报告基金份额净值增长率为 -12%, 业绩比较基准收益率为 -10%。

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

Table with 3 columns: 序号, 投资组合, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

注: 本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 250,062,237.67 元, 占期末净值比例 80.2%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金总资产比例(%)

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

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值(元), 占基金总资产比例(%)

注: 本基金本报告期末持有资产支持证券。

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投资。

5.9 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投资。

6. 基金资产净值及基金份额净值

截至本报告期末, 本基金资产净值为 110 元, 基金份额净值为 1.10 元。

7. 基金管理人承诺

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, 也不保证基金资产净值不受损失。

8. 基金托管人承诺

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证基金资产净值不受损失。

9. 基金销售机构

基金销售机构: 汇添富基金管理股份有限公司

10. 基金管理人联系方式

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

11. 基金管理人网址

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

12. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

13. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

14. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

15. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

16. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

17. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

18. 基金管理人联系方式

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司