# 汇添富移动互联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 | 汇添富移动互联股票 |
| 交易代码 | 000697 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年8月26日 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,238,464,680.09份 |
| 投资目标 | 本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，精选移动互联主题的优质上市公司，结合市场脉络，做中长期布局，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 | 本基金采用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；个股精选策略用于发掘移动互联主题相关的上市公司中商业模式独特、竞争优势明显、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 | 中证移动互联网指数×80%+中债综合指数×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 |
| 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 |

§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 | -443,983,411.17 |
| 2.本期利润 | -773,500,204.00 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1802 |
| 4.期末基金资产净值 | 4,497,584,645.65 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.061 |

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。

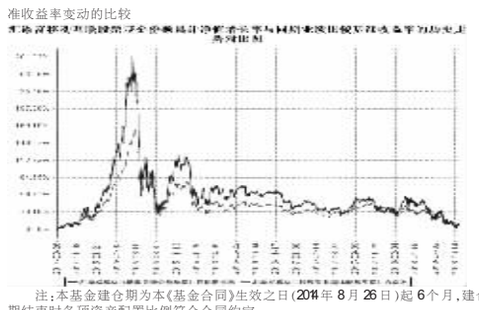
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -14.44% | 1.74% | -8.12% | 1.40% | -6.32% | 0.34% |

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（2014年8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 | | |
| 欧阳沁春 | 汇添富社会责任混合基金、汇添富移动互联股票基金的基金经理，移动互联网行业投资总监。 | 2014年8月26日 | - | 17年 | 国籍：中国。学历：卫生部武汉生物制品研究所医学硕士、中欧国际工商学院工商管理硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任卫生部武汉生物制品研究所助理研究员、中国网络（百慕大）有限公司项目经理、大成基金管理有限公司行业研究员、国联安基金管理有限公司行业研究员，2006年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任移动互联网行业投资总监，2007年6月18日至2012年3月2日任汇添富均衡增长混合基金的基金经理，2011年3月29日至今任汇添富社会责任混合基金的基金经理，2014年8月26日至今任汇添富移动互联股票基金的基金经理，2017年1月25日至2018年5月16日任汇添富全球移动互联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

2018年三季度A股市场受贸易摩擦的巨大影响，出现了非常大的分化：其中上证指数下跌0.92%，深圳成指下跌10.43%，创业板指表现更弱，大跌12.15%。以上证50为代表的流动性好、行业代表性强的蓝筹股表现突出，逆势上涨了5.11%。而且行业中个股分化极大，行业的龙头企业都显现了不错的投资价值。宏观经济角度方面：美国的货币政策收紧是中长期趋势，未来几年可能出现持续加息状态，中国的货币政策或出现一定的灵活性，与美国的货币政策出现一定背离。国内经济保持平稳，中美贸易摩擦会进入常态。

汇添富移动互联继续遵守基金契约，在市场震荡时逐步调整了投资结构，减持了部分高估值的股票，在行业配置方面：我们增加配置部分大蓝筹股票，保持组合的稳定性，我们在互联网和新经济各个相关的行业做了全面的布局，我们主要投资了大数据、云计算、消费金融和自主可控的行业与公司，部分行业公司已经表现出了非常好的经营数据，体现出了强劲的竞争力，我们对于新能源的产业链上游与锂电设备做了适当的减持，并减持了部分安防公司股票。

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1.061元；本报告期基金份额净值增长率为-14.44%，业绩比较基准收益率为-8.12%。

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 | 4,044,154,299.42 | 87.94 |
| | 其中：股票 | 4,044,154,299.42 | 87.94 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 476,500,523.40 | 10.36 |
| 8 | 其他资产 | 78,279,919.55 | 1.70 |
| 9 | 合计 | 4,598,934,742.37 | 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 | 92,143,654.24 | 2.05 |
| C | 制造业 | 2,408,240,226.76 | 53.55 |
| 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 | 1,316,108,882.95 | 29.26 |
| J | 金融业 | 154,857,875.85 | 3.44 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 72,803,659.62 | 1.62 |
| 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 | 4,044,154,299.42 | 89.92 |

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 | 603799 | 华友钴业 | 7,321,781 | 390,177,709.49 | 8.68 |
| 2 | 002466 | 天齐锂业 | 8,676,669 | 329,973,722.07 | 7.34 |
| 3 | 300618 | 寒锐钴业 | 1,998,285 | 254,841,286.05 | 5.67 |
| 4 | 002668 | 奥马电器 | 24,473,579 | 236,659,508.93 | 5.26 |
| 5 | 603019 | 中科曙光 | 4,769,411 | 223,589,987.68 | 4.97 |
| 6 | 300348 | 长亮科技 | 8,553,607 | 209,819,979.71 | 4.67 |
| 7 | 300450 | 先导智能 | 7,942,187 | 208,720,674.36 | 4.64 |
| 8 | 300226 | 上海钢联 | 4,003,668 | 190,974,963.60 | 4.25 |
| 9 | 000977 | 浪潮信息 | 7,709,244 | 185,638,595.52 | 4.13 |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 2,254,801 | 154,453,868.50 | 3.43 |

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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投资。

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中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 986,309.08 |
| 2 | 应收证券清算款 | 74,863,028.32 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 95,323.28 |
| 5 | 应收申购款 | 2,335,258.87 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 78,279,919.55 |

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 | 002668 | 奥马电器 | 236,659,508.93 | 5.26 | 重大事项停牌 |

§6开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 4,163,347,848.75 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 479,089,604.55 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 403,972,773.21 |
| 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 | 4,238,464,680.09 |

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。

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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移动互联股票型证券投资基金募集的文件；

2.《汇添富移动互联股票型证券投资基金基金合同》；

3.《汇添富移动互联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.报告期内汇添富移动互联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。

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

# 汇添富行业整合主题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日至9月30日止。

§2基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 添富行业整合混合 |
| 交易代码 | 005351 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年2月13日 |
| 报告期末基金份额总额 | 601,495,766.96份 |
| 投资目标 | 本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，重点投资于行业整合主题相关的优质上市公司，谋求基金资产的中长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金为混合型基金。投资策略主要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优质的行业整合主题上市公司。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*20%+中债综合财富指数收益率*30% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。<br>本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |
| 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 | -6,905,537.73 |
| 2.本期利润 | -38,418,002.42 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0615 |
| 4.期末基金资产净值 | 563,771,510.47 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9373 |

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。

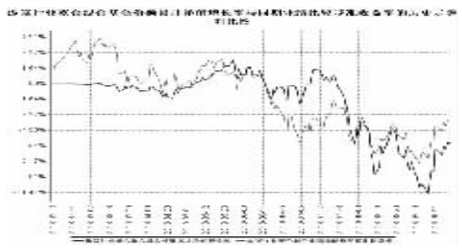
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -6.08% | 1.03% | -0.42% | 0.84% | -5.66% | 0.19% |

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



注：本《基金合同》生效日为2018年2月13日，截止至本报告期末，基金成立未满一年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2018年2月13日）起6个月，截止至本报告期末，本基金已完成建仓，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 | | |
| 赵鹏程 | 汇添富沪港深新价值股票基金、添富行业整合混合基金的基金经理。 | 2018年2月13日 | - | 7年 | 国籍：中国，学历：浙江大学高分子化学与物理硕士。曾任天相投资股份有限公司研究员、信诚基金管理有限公司研究员。2011年8月加入汇添富基金管理有限公司任高级行业分析师。2016年7月27日至今任汇添富沪港深新价值股票基金的基金经理，2018年2月13日至今任添富行业整合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

2018年三季度A股、H股震荡下行，市场结构分化加剧。从行业表现看，A股市场金融板块上涨超4%，采掘、钢铁涨2%以上，而有色、轻工、传媒板块下跌超10%，H股市场能源、电讯板块涨幅超8%，工业、消费和科技跌幅达10%以上。从市场风格看，大盘蓝筹股相对抗跌，中小创跌幅较大。本基金三季度仍维持了较低的股票仓位，增持了A股的金融股和公用事业股，同时在化工、造纸等受益于环保趋严和供给侧改革的行业中精选个股进行配置。由于组合中重仓的医药、教育股遭遇政策、事件冲击跌幅较大，三季度本基金净值跑输业绩比较基准。

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0.9373元；本报告期基金份额净值增长率为-6.08%，业绩比较基准收益率为-0.42%。

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 | 376,362,916.80 | 58.33 |
| | 其中：股票 | 376,362,916.80 | 58.33 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 75,000,000.00 | 11.62 |
| | 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 | 192,206,422.19 | 29.79 |
| 8 | 其他资产 | 1,692,783.38 | 0.26 |
| 9 | 合计 | 645,262,122.37 | 100.00 |

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69,849,639.05元，占期末净值比例12.39%。

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 | 5,655,000.00 | 1.00 |
| C | 制造业 | 184,695,424.08 | 32.76 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 26,205,903.36 | 4.65 |
| 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 | 49,705,500.00 | 8.82 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 6,802.00 | 0.00 |
| 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 | 34,237,148.31 | 6.07 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 6,007,500.00 | 1.07 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 306,513,277.75 | 54.37 |

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| A 基础材料 | - | - |
| B 消费者非必需品 | 29,146,143.88 | 5.17 |
| C 消费者常用品 | - | - |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | - | - |
| F 医疗保健 | - | - |
| G 工业 | 24,732,754.65 | 4.39 |
| H 信息技术 | 12,940,192.72 | 2.30 |
| I 电信服务 | 3,030,547.80 | 0.54 |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 69,849,639.05 | 12.39 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

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 | 002044 | 美年健康 | 1,799,997 | 31,013,948.31 | 5.50 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 950,000 | 29,155,500.00 | 5.17 |
| 3 | 600900 | 长江电力 | 1,599,872 | 26,205,903.36 | 4.65 |
| 4 | 002466 | 天齐锂业 | 600,005 | 22,818,190.15 | 4.05 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 300,000 | 20,550,000.00 | 3.65 |
| 6 | 600867 | 通化东宝 | 1,099,922 | 19,952,585.08 | 3.54 |
| 7 | 600436 | 片仔癀 | 180,000 | 18,226,800.00 | 3.23 |
| 8 | 000661 | 长春高新 | 70,000 | 16,590,000.00 | 2.94 |
| 9 | 300285 | 国瓷材料 | 849,966 | 15,809,367.60 | 2.80 |
| 10 | 00586 | 海螺创业 | 650,000 | 15,614,712.75 | 2.77 |

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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投资。

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：本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

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、处罚的情形。

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 | 272,395.42 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,342,149.66 |
| 3 | 应收股利 | 43,680.86 |
| 4 | 应收利息 | 34,557.44 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,692,783.38 |

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末无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

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 | 651,990,515.16 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,482,687.08 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 52,977,435.28 |
| 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 | 601,495,766.96 |

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.中国证监会准予汇添富行业整合主题混合型证券投资基金注册的文件；

2.《汇添富行业整合主题混合型证券投资基金基金合同》；

3.《汇添富行业整合主题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.报告期内汇添富行业整合主题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

# 汇添富香港优势精选混合型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

2018年09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

2.1基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富香港优势精选混合(QDII) |
| 交易代码 | 470888 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年06月25日 |
| 报告期末基金份额总额 | 179,046,534.99份 |
| 投资目标 | 在香港证券市场精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的公司股票等证券，通过有效的资产配置和组合管理，进行中长期投资布局，在有效管理风险的前提下，追求持续稳健的较高投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用"自下而上"的策略，精选出具有持续竞争优势，且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。 |
| 业绩比较基准 | MSCI中华指数（MSCI ZhongHua Index）。 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，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 |

注：根据中国证券监督管理委员会于2014年8月8日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，汇添富基金管理股份有限公司（以下简称"本公司"）决定自2016年8月5日起将本公司旗下"汇添富香港优势股票型证券投资基金"的基金名称变更为"汇添富香港优势精选混合型证券投资基金"，基金类型由股票基金变更为混合基金，并相应修改本基金的《基金合同》。

2.2境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外资产托管人 |
|---|---|---|
| 名称 | 中文 | 布朗兄弟哈里曼银行 |
| | 英文 | Brown Brothers Harriman & Co. |
| 注册地址 | | 140 Broadway New York，NY 10005 |
| 办公地址 | | 140 Broadway New York，NY 10005 |
| 邮政编码 | | NY 10005 |

注：本基金无境外投资顾问。

§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07月01日-2018年09月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -21,022,467.56 |
| 2.本期利润 | -24,119,765.10 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1255 |
| 4.期末基金资产净值 | 179,084,641.48 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.000 |

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。

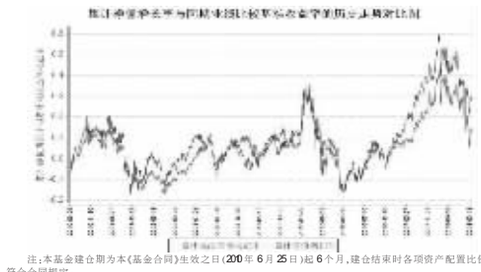
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -11.11% | 1.54% | -6.90% | 1.16% | -4.21% | 0.38% |

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6月25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 | | |
| 倪健 | 汇添富香港优势精选混合基金、添富港股通专注成长基金的基金经理。 | 2015年10月27日 | | 15年 | 国籍：中国，学历：美国哥伦比亚大学公共管理硕士、清华大学工程硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格，特许金融分析师（CFA），财务风险经理人（FRM）。从业经历：曾任中国银河证券有限责任公司投资银行总部、股票发行部业务经理，中信证券国际资产管理（香港）有限公司投资分析员，五矿资本（香港）有限公司投资组合经理。2015年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，2015年10月27日起任汇添富香港优势精选混合基金的基金经理，2017年11月10日至今任添富港股通专注成长基金的基金经理。 |

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境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4公平交易专项说明

4.4.1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