

汇添富安心中国债券型证券投资基金

2018年第四季度报告

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:2019年1月21日

1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告中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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资收益等数据,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。

本报告期为2018年10月1日起至2018年12月31日止。

2 基金基本情况

基金简称	汇添富安心中国债券
基金代码	000339
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2013年11月22日
报告期末基金份额总额	221,443,627.61份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过重点投资信用评级较高的债券,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产净值的90%,其中投资于高等信用债券的比例不低于基金资产净值的70%;持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
业绩比较基准	中证综合债指数
风险收益特征	本基金为纯债基金,属于证券投资基金中较低风险品种,长期稳健增值,其预期风险和预期收益低于市场基金,低于普通股票型基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	汇添富安心中国债券A 汇添富安心中国债券C
下属分级基金的代码	000336 000368
报告期末下属分级基金的份额总额	191,817,130.14份 29,626,507.47份

3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元			
主要财务指标	报告期(2018年10月1日至2018年12月31日)	报告期(2018年10月1日至2018年12月31日)	报告期(2018年10月1日至2018年12月31日)
1.本期已实现收益	2,419,676.26	2,419,676.26	29,723,292.29
2.本期利润	3,478,100.10	3,478,100.10	382,263,292.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.0162	0.0162	0.0161
4.期末基金资产净值	223,628,360.41	223,628,360.41	36,536,872.27
5.期末基金份额净值	1.217	1.217	1.233

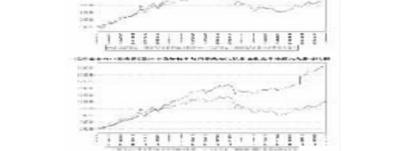
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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可能低于业绩指标水平。

3.2 基金净值表现

汇添富安心中国债券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标准差③	①-③	②-③	
过去三个月	15.0%	0.08%	1.95%	0.03%	-0.49%	0.01%
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标准差③	①-③	②-③	
过去三个月	1.48%	0.05%	1.93%	0.05%	-0.51%	0.00%

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:本基金建仓期为自本基金(含各子基金)生效之日(2013年11月22日)起6个月,建仓结束后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	任职日期	离任日期	证券从业年限
胡皓	基金经理	2013/11/22	-	10年

胡皓,男,中国国籍,毕业于中国政法大学,硕士研究生学历,证券从业年限10年。曾任汇添富基金研究员、基金经理助理,现任汇添富基金基金经理。2013年11月22日起担任汇添富安心中国债券基金经理。2014年11月11日起担任汇添富安心中国债券A基金经理。2015年11月11日起担任汇添富安心中国债券C基金经理。2016年11月11日起担任汇添富安心中国债券基金经理。2017年11月11日起担任汇添富安心中国债券基金经理。2018年11月11日起担任汇添富安心中国债券基金经理。2019年11月11日起担任汇添富安心中国债券基金经理。

4.2 基金的投资情况

4.2.1 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	-	-
2	固定收益投资	200,742,967.70	94.11
3	金融资产投资	200,742,967.70	94.11
4	买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	10,975,854.54	3.96
6	其他资产	6,367,089.89	1.03
7	合计	217,775,912.04	100.00

4.2.2 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	180210	18国债10	100,000	10,313,000.00	3.62
2	180207	18国债07	100,000	10,272,000.00	3.70
3	113947	18国债01	100,000	10,248,000.00	3.89
4	143705	18国债01	100,000	10,239,000.00	3.79
5	143835	18国债01	100,000	10,226,000.00	3.79

4.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	180210	18国债10	100,000	10,313,000.00	3.62
2	180207	18国债07	100,000	10,272,000.00	3.70
3	113947	18国债01	100,000	10,248,000.00	3.89
4	143705	18国债01	100,000	10,239,000.00	3.79
5	143835	18国债01	100,000	10,226,000.00	3.79

4.2.4 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

序号	贵金属名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.5 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权证投资

序号	权证名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资

序号	资产支持证券名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.7 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买入返售金融资产

序号	买入返售金融资产名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.8 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银行存款和结算备付金

序号	名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.9 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其他资产

序号	其他资产名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.10 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

序号	权证名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.11 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资产支持证券投资

序号	资产支持证券名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.12 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买入返售金融资产

序号	买入返售金融资产名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.13 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银行存款和结算备付金

序号	名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.14 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其他资产

序号	其他资产名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.15 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

序号	权证名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.16 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资产支持证券投资

序号	资产支持证券名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.17 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买入返售金融资产

序号	买入返售金融资产名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.18 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银行存款和结算备付金

序号	名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.19 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其他资产

序号	其他资产名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.20 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

序号	权证名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.21 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资产支持证券投资

序号	资产支持证券名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.22 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买入返售金融资产

序号	买入返售金融资产名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.23 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银行存款和结算备付金

序号	名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.24 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其他资产

序号	其他资产名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.25 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

序号	权证名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.26 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资产支持证券投资

序号	资产支持证券名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.27 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买入返售金融资产

序号	买入返售金融资产名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.28 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银行存款和结算备付金

序号	名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.29 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其他资产

序号	其他资产名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.30 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

序号	权证名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.31 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资产支持证券投资

序号	资产支持证券名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.32 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买入返售金融资产

序号	买入返售金融资产名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

4.2.33 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银行存款和结算备付金

序号	名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	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	-	-
2	固定收益投资	200,742,967.70	94.11
3	金融资产投资	200,742,967.70	94.11
4	买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	10,975,854.54	3.96
6	其他资产	6,367,089.89	1.03
7	合计	217,775,912.04	100.00

5.2 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	180210	18国债10	100,000	10,313,000.00	3.62
2	180207	18国债07	100,000	10,272,000.00	3.70
3	113947	18国债01	100,000	10,248,000.00	3.89
4	143705	18国债01	100,000	10,239,000.00	3.79
5	143835	18国债01	100,000	10,226,000.00	3.79

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五名股票投资

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	180210	18国债10	100,000	10,313,000.00	3.62
2	180207	18国债07	100,000	10,272,000.00	3.70
3	113947	18国债01	100,000	10,248,000.00	3.89
4	143705	18国债01	100,000	10,239,000.00	3.79
5	143835	18国债01	100,000	10,226,000.00	3.79

5.4 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

序号	贵金属名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

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权证投资

序号	权证名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

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五名资产支持证券投资

序号	资产支持证券名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

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买入返售金融资产

序号	买入返售金融资产名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

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银行存款和结算备付金

序号	名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

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其他资产

序号	其他资产名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

5.10 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

序号	权证名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	-	-	-

5.11 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资产支持证券投资