汇添富多元收益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2019年1月17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10月1日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富多元收益债券
基金主代码	470010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月18日
报告期末基金份额总额	201,028,277.35份
投资目标	本基金主要投资于债券类固定收益品种,在承担合理风险和保持资产流动性的基础上,追求参与权益类资产投资,力争实现资产的长期稳定增值。
投资策略	基金的投资组合比例为:本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%,权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%,其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,持有的现金或到期日在1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	中债综合指数×90%+沪深300指数×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	汇添富多元收益债券A / 汇添富多元收益债券C
下属分级基金的交易代码	470010 / 470011
报告期末下属分级基金的份额总额	180,905,749.21份 / 20,122,528.14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10月1日-2018年12月31日)	报告期(2018年10月1日-2018年12月31日)
	汇添富多元收益债券A	汇添富多元收益债券C
1.本期已实现收益	-7,762,416.92	-1,175,040.35
2.本期利润	-4,273,918.37	119,300.71
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0203	0.0026
4.期末基金资产净值	210,094,251.77	23,194,595.39
5.期末基金份额净值	1.161	1.153

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

汇添富多元收益债券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③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.44%	0.31%	0.55%	0.16%	-1.99%	0.15%

汇添富多元收益债券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	-1.45%	0.31%	0.55%	0.16%	-2.00%	0.15%

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(2012年9月18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		
郑慧莲	汇添富双利增强债券、汇添富双利债券、添富年年丰定开混合、添富年年春定开混合、汇添富6月红定期开放债券、汇添富多元收益债券、添富年年益定开混合、添富熙和混合、汇添富安鑫智选混合、汇添富达欣混合、添富全球消费混合(QDII)、添富消费升级混合的基金经理。	2017年12月26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26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、添富年年丰定开混合、添富年年春定开混合、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、添富年年益定开混合的基金经理,2018年3月1日至今担任添富熙和混合的基金经理,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日至今任添富全球消费混合(QDII)的基金经理,2018年12月21日至今任添富消费升级混合的基金经理。
曾刚	汇添富多元收益、可转换债券、实业债债券、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、汇添富益安保本混合基金、汇添富益稳保本混合基金、汇添富长添利定期开放债券基金、添富年年益定开混合基金、汇添富长添利定期开放债券基金、添富熙和混合基金、汇添富达欣混合基金的基金经理,能金管理部总经理。	2012年9月18日	-	17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业研究员、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,2016年2月13日至今任添富沪港深优势精选混合的基金经理,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26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日至今任汇添富实业债基金的基金经理,2013年9月12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日至今任汇添富益安保本混合基金的基金经理,2016年6月31日至今任汇添富稳健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日至今任添富年年益定开混合的基金经理,2018年2月11日至今任添富熙和混合基金的基金经理,2018年7月6日至今任汇添富达欣混合基金的基金经理。

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6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年四季度,全球经济的增长逐渐出现趋缓的迹象,领先指标表现不佳。美联储的加息和缩表行动对市场的影响,正逐渐加大。叠加就业、工资、制造业等数据的波动,导致了美国资本市场的大幅震荡,并进而影响了全球大部分市场。和前一个季度完全相反的是,由于短期供需以及明年全球需求走弱的预期变化,原油等大宗商品的价格经历了较大幅度的下行调整。本季度,美联储此轮持续加息、缩表的影响逐渐放大,叠加经济数据等诸多负面影响,加大了美股的波动,进而给港股市场带来了较大压力。虽然,有中美贸易摩擦缓和等正面因素,但是,对于经济前景的悲观、全球风险偏好的下行,以及年底资金回笼效应的影响等,持续压制着本季度港股的表现。弱势之中,防御型板块的相对收益较高。医药、新能源等板块仍然受压于行业政策的变化,表现弱于大盘。本基金在四季度保持持仓结构不变,持仓重心继续保持在弱经济周期、景气度持续上行的行业,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0.955元;本报告期基金份额净值增长率为-13.96%,业绩比较基准收益率为-8.56%。

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	253,448,700.10	79.89
	其中:股票	253,448,700.10	79.89
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	63,784,767.57	20.11
8	其他资产	14,784.48	0.00
9	合计	317,248,252.15	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253,448,700.10元,占期末净值比例80.11%。

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投资境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	4,104,000.00	1.76
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	-	-
J	金融业	152.88	0.00
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	-	-
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	4,104,152.88	1.76

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

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	002507	涪陵榨菜	190,000	4,104,000.00	1.76
2	601939	建设银行	24	152.88	-

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	30,151,000.00	12.92
	其中:政策性金融债	20,086,000.00	8.61
4	企业债券	200,355,759.90	85.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	12,492,967.50	5.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	242,999,727.40	104.16

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	143576	18兆证G2	200,000	20,414,000.00	8.75
2	143573	18杭金01	200,000	20,412,000.00	8.75
3	143570	18兵器01	200,000	20,320,000.00	8.71
4	180407	18农发07	200,000	20,086,000.00	8.61
5	136502	16糖投01	200,000	19,706,000.00	8.45

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:本基金本报告期末未投资国债期货。

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	53,305.66
2	应收证券清算款	404,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	4,981,064.88
5	应收申购款	35,913.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,474,284.15

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	113015	隆基转债	2,710,243.10	1.16
2	110042	航电转债	2,673,250.00	1.15
3	128028	赣锋转债	1,721,700.00	0.74
4	113019	玖龙转债	1,194,000.00	0.51
5	113014	林洋转债	1,186,625.00	0.51
6	123006	东时转债	695,940.00	0.30
7	113508	新风转债	289,020.00	0.12

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无流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富多元收益债券A	汇添富多元收益债券C
报告期期初基金份额总额	271,120,548.63	19,300,284.37
报告期期间基金总申购份额	29,753,833.26	76,644,498.13
减:报告期期间基金总赎回份额	119,968,632.68	75,822,254.36
报告期期末基金份额总额	180,905,749.21	20,122,528.14

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

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
		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10月1日至2018年10月9日	83,124,688.28	0.00	57,320,000.00		25,804,688.28	12.84
	2	2018年10月1日至2018年12月31日	69,624,272.66	-	20,000,000.00		49,624,272.66	24.69
	3	2018年12月25日至2018年12月28日	40,136,243.94	-	-		40,136,243.94	19.97
	4	2018年10月26日至2018年11月26日	-	74,236,807.86	74,236,807.86		-	0.00
个人	-	-	-	-	-		-	-

产品特有风险

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,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多元收益债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富多元收益债券型证券投资基金合同》;

3、《汇添富多元收益债券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、报告期内汇添富多元收益债券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1月21日

汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金

2018年第四季度报告

2018年第4季度报告
2018年12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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月17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10月1日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富沪港深新价值股票
基金主代码	001685
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年7月27日
报告期末基金份额总额	331,362,740.37份
投资目标	本基金精选相对低估的优质企业进行中长期投资,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,谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中,在资产配置中,在综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素的基础上,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、货币市场工具盘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;在股票投资中,采取"自下而上"的策略,优选价值相对低估的优质公司股票构建投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得长期持续稳健的投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+恒生指数收益率 (使用估值汇率折算)×20%+中债综合指数收益率×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	中国建设银行股份有限公司

§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10月1日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-7,267,479.66
2.本期利润	-51,578,895.27
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1556
4.期末基金资产净值	316,367,189.74
5.期末基金份额净值	0.955

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	-13.96%	1.88%	-8.56%	1.24%	-5.40%	0.64%

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(2016年7月27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		
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。	2016年7月27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业研究员、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,2016年2月13日至今任添富沪港深优势精选混合的基金经理。
姚耀强	汇添富策略回报混合基金、汇添富逆向投资混合基金、汇添富沪港深新价值股票基金、汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理。	2016年7月27日	-	14年	国籍:中国。学历:南华大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任杭州永康集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任高级行业分析师、基金经理助理。2009年12月22日至今任汇添富策略回报混合基金的基金经理,2012年3月9日至今任汇添富逆向投资混合基金的基金经理,2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合基金的基金经理,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,2017年3月15日至今任汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理。
余中强	汇添富沪港深新价值股票基金、汇添富均衡增长混合基金、添富稳投资专注成长基金的基金经理。	2016年8月1日	-	11年	国籍:中国。学历:香港城市大学博士、清华大学MBA学位。从业经历:曾任香港英盟汇骏基金管理有限公司研究主任、香港游宁投资有限公司投资经理、东兴证券股份有限公司投资经理、齐鲁证券有限公司北京证券资产管理分公司执行总经理、华商盛世成长股票型基金基金经理助理、华商产业升级混合型基金基金经理。2016年1月加入汇添富基金管理股份有限公司,2016年8月1日至今任汇添富沪港深新价值股票基金的基金经理,2016年8月24日至今任汇添富均衡增长混合基金的基金经理,2017年11月10日至今任添富稳投资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 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6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年四季度,全球经济的增长逐渐出现趋缓的迹象,领先指标表现不佳。美联储的加息和缩表行动对市场的影响,正逐渐加大。叠加就业、工资、制造业等数据的波动,导致了美国资本市场的大幅震荡,并进而影响了全球大部分市场。和前一个季度完全相反的是,由于短期供需以及明年全球需求走弱的预期变化,原油等大宗商品的价格经历了较大幅度的下行调整。本季度,美联储此轮持续加息、缩表的影响逐渐放大,叠加经济数据等诸多负面影响,加大了美股的波动,进而给港股市场带来了较大压力。虽然,有中美贸易摩擦缓和等正面因素,但是,对于经济前景的悲观、全球风险偏好的下行,以及年底资金回笼效应的影响等,持续压制着本季度港股的表现。弱势之中,防御型板块的相对收益较高。医药、新能源等板块仍然受压于行业政策的变化,表现弱于大盘。本基金在四季度保持持仓结构不变,持仓重心继续保持在弱经济周期、景气度持续上行的行业,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0.955元;本报告期基金份额净值增长率为-13.96%,业绩比较基准收益率为-8.56%。

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	253,448,700.10	79.89
	其中:股票	253,448,700.10	79.89
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	63,784,767.57	20.11
8	其他资产	14,784.48	0.00
9	合计	317,248,252.15	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253,448,700.10元,占期末净值比例80.11%。

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投资境内股票。

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(元)	占基金资产净值比例(%)
A 基础材料	423,940.61	0.13
B 消费者非必需品	37,397,893.92	11.82
C 消费者常用品	32,968,514.54	10.42
D 能源	31,372,691.48	9.92
E 金融	29,372,712.41	9.28
F 医疗保健	44,039,861.65	13.92
G 工业	8,796,646.08	2.78
H 信息技术	46,322,174.93	14.64
I 电信服务	19,299,181.20	6.10
J 公用事业	559,366.08	0.18
K 房地产	2,896,717.20	0.92
合计	253,448,700.10	80.11

注:(1)以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

(2)于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	00268	金蝶国际	4,166,000	25,259,724.46	7.98
2	02319	蒙牛乳业	976,000	20,866,177.28	6.60
3	00981	中芯国际	3,186,500	19,125,277.41	6.05
4	00386	中国石油化工股份	3,900,000	19,102,036.20	6.04
5	01398	工商银行	3,816,000	18,690,607.73	5.91
6	01093	石药集团	1,660,000	16,435,759.60	5.20
7	02313	申洲国际	160,000	12,442,040.00	3.93
8	01112	H&H国际控股	309,000	12,102,337.26	3.83
9	01293	广汇宝信	6,161,500	11,931,140.92	3.77
10	00700	腾讯控股	36,600	10,069,640.88	3.18

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。

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。

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:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	665.21
4	应收利息	14,119.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,784.48

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

注:本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	332,915,669.15
报告期期间基金总申购份额	9,664,323.87
减:报告期期间基金总赎回份额	11,217,252.65
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	331,362,740.37

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

| 投资者类别 | 序号