汇添富睿丰混合型证券投资基金

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	添富睿丰
基金主代码	501039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月29日
报告期末基金份额总额	332,816,128.72份
投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类资产,并通过投资股票等权益类资产增强收益,在科学严格管理风险的前提下,力争创造超越业绩比较基准的长期稳健收益。
投资策略	本基金将密切关注市场的运行状况与风险收益特征,分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势,判断不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值,以动态调整大类资产配置比例。在此基础上,灵活运用债券投资策略、股票精选策略等。 封闭期内,本基金采取的投资策略主要为资产配置策略、债券投资策略、定向增发策略、定增破发策略、股票精选策略等;转为上市开放式基金后,本基金采取的投资策略主要为资产配置策略、债券投资策略、股票精选策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金,低于股票型基金,属于中等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	中国银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	汇添富睿丰混合A	汇添富睿丰混合C
下属分级基金的场内简称	添富睿丰	添富睿C
下属分级基金的交易代码	501039	501040
报告期末下属分级基金的份额总额	227,597,293.85份	105,218,834.87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)
	汇添富睿丰混合A	汇添富睿丰混合C
1.本期已实现收益	196,103.40	－19,392.21
2.本期利润	3,706,683.24	1,596,999.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.0163	0.0152
4.期末基金资产净值	236,576,045.54	108,822,206.10
5.期末基金份额净值	1.0395	1.0342

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

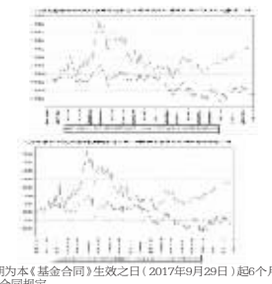
汇添富睿丰混合A

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	1.59%	0.09%	－0.90%	0.32%	2.49%	－0.23%

汇添富睿丰混合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	1.48%	0.09%	－0.90%	0.32%	2.38%	－0.23%

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(2017年9月29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		
赵鹏飞	汇添富多策略定开混合、汇添富睿丰混合基金、鼎信民安增益定开混合基金、添富民安增益定开混合基金、汇添富弘安混合基金、汇添富精选混合基金、汇添富移动互联股票基金的基金经理。	2017年9月29日	－	10年	国籍:中国。学历:北大证券和光华学院产、担任高级投资经理等岗位。2015年8月加入汇添富基金。2016年6月3日至今任汇添富多策略定开混合基金的基金经理。2017年3月20日至今任汇添富高端制造股票基金的基金经理。2017年9月27日至今任汇添富民丰回报基金的基金经理。2017年9月29日至今任汇添富弘安混合基金的基金经理。2017年9月29日至今任汇添富睿丰混合基金的基金经理。2018年3月19日至今任添富民安增益定开混合基金的基金经理。2018年4月12日至今任添富智慧制造股票基金的基金经理。
蒋文玲	汇添富货币基金、现金宝货币基金、添富通货币基金、实业债债券基金、优选回报混合基金、汇添富鑫通稳定开债基金、添富年益定开混合、添富睿丰定开债基金、汇添富睿丰债券基金、汇添富新睿精选混合基金、添富短债债券基金、添富丰利中短债基金的基金经理、汇添富多元收益债券基金的基金经理助理。	2018年8月2日	－	12年	国籍:中国。学历:上海财经大学经济学硕士、金融学硕士、证券投资基金从业资格。从业经历:曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015年6月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理,2015年6月31日至今任中证主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金、汇添富中证主要消费ETF联接基金的基金经理,2015年9月18日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富主要消费ETF联接基金、汇添富中证生物科技指数(LOF)基金、汇添富中证中药指数(LOF)基金、汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF)基金、中证银行ETF基金的基金经理。
赖中立	汇添富黄金及贵金属基金(LOF)的基金经理、汇添富恒生指数分级(QDII)基金、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富中证环境治理指数(LOF)基金、汇添富优选回报混合基金、汇添富中证港股通高股息投资指数(LOF)基金的基金经理。	2015年1月6日	－	11年	国籍:中国。学历:北京大学中国经济研究中心金融学硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属基金(LOF)的基金经理,2014年3月6日至今任汇添富恒生指数分级(QDII)基金的基金经理,2015年1月6日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理,2015年5月26日至2016年7月13日任汇添富香港优势混合基金的基金经理,2016年12月29日至今任汇添富中证港股通高股息投资指数(LOF)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

四季度经济下行趋势更加严峻,10月份调整口径之后的新增社融环比几近腰斩,11月份工业企业利润同比增幅由上月的3.6%降至-1.8%,3年来首次由正转负,12月末的PMI也低于50荣枯线,同样为近三年的最低值。与此同时,受油价和经济拖累,PPI同比逐月走低,环比开始转负,市场对于3季度以来的通胀预期迅速消退,转而担忧通缩风险。政策方面,四季度财政政策和货币政策共同发力,财政支持明显加大,减税降费措施陆续出台,货币政策维持宽松稳健,央行采取了10月份降准、12月末创设TMLF等方式投放流动性,降低社会融资成本,但经济下行周期中社会风险偏好较难提振,宽信用效果不佳。

四季度债市在基本面和政策面配合下,快速上涨,其中10年国开有效突破4%,下降50-60BP至3.65%的年内低位,而1年以内的短债受制于利率走廊管控和年末银行流动性覆盖指标的约束,下行幅度仅为10-15BP,收益率曲线呈现牛平形态。

股票市场继续调整,上证综指下跌12.42%,深圳成指下跌22.81%,沪深300下跌14.25%,跌幅相对二季度均显著放大。

考虑到基本面有利于债市,本基金在债券投资策略上依然较为乐观,在封闭期内维持较高的杠杆策略和久期,并利用震荡格局进行波段交易操作。权益部分整体仓位较低,以控制波动风险,并延续"行业相对均衡、个股适度集中、适时动态调整"的风格和思路,操作上,淡化风格和择时,坚持自下而上精选个股的投资策略,兼顾价值和成长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富睿丰混合A基金份额净值为1.0395元,本报告期基金份额净值增长率为1.59%;截至本报告期末汇添富睿丰混合C基金份额净值为1.0342元,本报告期基金份额净值增长率为1.48%;同期业绩比较基准收益率为-0.90%。

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	134,388.72	0.02
	其中:股票	134,388.72	0.02
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	544,324,376.90	95.76
	其中:债券	544,324,376.90	95.76
	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	14,562,590.65	2.56
8	其他资产	9,426,467.26	1.66
9	合计	568,447,823.53	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	45,387.72	0.01
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	89,001.00	0.03
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	134,388.72	0.04

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	601990	南京证券	10,230	89,001.00	0.03
2	603013	亚普股份	2,573	45,387.72	0.01

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	74,835,800.00	21.67
	其中:政策性金融债	－	－
4	企业债券	437,336,678.70	126.62
5	企业短期融资券	－	－
6	中期票据	30,615,000.00	8.86
7	可转债(可交换债)	1,536,898.20	0.44
8	同业存单	－	－
9	其他	－	－
10	合计	544,324,376.90	157.59

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	122292	13兴业01	300,000	30,111,000.00	8.72
2	143526	18老客01	200,000	20,564,000.00	5.95
3	143789	18中车G1	200,000	20,522,000.00	5.94
4	143576	18光证G2	200,000	20,414,000.00	5.91
5	143868	18电投09	200,000	20,344,000.00	5.89

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	59,726.88
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	9,366,740.38
5	应收申购款	－
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	9,426,467.26

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

项目	汇添富睿丰混合A	汇添富睿丰混合C
报告期期初基金份额总额	227,597,293.85	105,218,834.87
报告期期间基金总申购份额	－	－
减:报告期期间基金总赎回份额	－	－
报告期期末基金份额总额	227,597,293.85	105,218,834.87

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内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睿丰混合型证券投资基金注册的文件;

2、《汇添富睿丰混合型证券投资基金合同》;

3、《汇添富睿丰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、报告期内汇添富睿丰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
2019年1月21日

汇添富社会责任混合型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	汇添富社会责任混合
基金主代码	470028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月29日
报告期末基金份额总额	2,193,251,445.96份
投资目标	精选积极履行社会责任,并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司,谋求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金。本基金投资的主要策略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积极履行社会责任的优质上市公司,以谋求基金资产稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
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	中国农业银行股份有限公司

§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	－710,012,625.58
2.本期利润	－632,223,007.05
3. 加权平均基金份额本期利润	－0.2839
4.期末基金资产净值	2,483,269,093.82
5.期末基金份额净值	1.132

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。

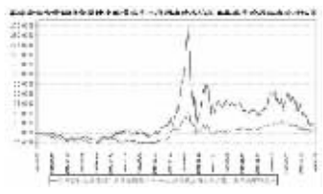
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	－20.17%	1.91%	－9.45%	1.31%	－10.72%	0.60%

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(2011年3月29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		
欧阳沁春	汇添富社会责任混合基金、汇添富任意回报混合基金、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。	2011年3月29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年四季度市场延续三季度的态势继续调整,国内宏观去杠杆、经济数据差强人意叠加中美贸易摩擦极大的损害了投资者的信心,整体A股四季度表现极为羸弱:上证50指数下跌12.03%,上证综指下跌11.61%,沪深300指数下跌12.45%,中小板指数下跌18.22%,创业板指数下跌11.39%。A股整体估值处于历史低位,成交低迷。从行业表现看,农林牧渔、综合和通信板块跌幅较小,而钢铁、采掘和医药生物板块跌幅居前。

宏观经济方面:美国的货币政策收紧已经接近尾声,中国的货币政策出现一定的灵活性,与美国的货币政策出现一定背离。国内经济可能会下一个台阶,中美贸易摩擦进入常态。

四季度社会责任基金投资依旧遵循行业相对均衡配置,个股适度集中的原则。我们一直在寻找业绩中高增点,估值相对合理或者低估的股票进行重点投资。在行业配置方面:我们新增了金融行业的大盘筹作为组合的基石。具备较深护城河的消费类和较快增速的医药企业也是组合配置的重点。我们也适当的配置了符合具备中长期成长脉络而且与宏观经济关联度不大的医疗信息化、教育信息化和云计算的龙头企业。

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1.132元;本报告期基金份额净值增长率为-20.17%,业绩比较基准收益率为-9.45%。

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	2,114,433,273.13	83.05
	其中:股票	2,114,433,273.13	83.05
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	33,679.40	0.00
	其中:债券	33,679.40	0.00
	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	428,999,757.14	16.85
8	其他资产	2,583,468.15	0.10
9	合计	2,546,050,177.82	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	2,440,837.00	0.10
C	制造业	868,445,139.82	34.97
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	980,488,973.56	39.48
J	金融业	57,647,894.00	2.32
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	106,191,641.25	4.28
R	文化、体育和娱乐业	99,218,787.50	4.00
S	综合	－	－
	合计	2,114,433,273.13	85.15

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	300450	先导智能	4,844,267	140,193,086.98	5.65
2	600570	恒生电子	2,373,130	123,355,297.40	4.97
3	300168	万达信息	10,259,383	123,010,002.17	4.95
4	300226	上海钢联	2,701,722	123,009,402.66	4.95
5	300348	长亮科技	6,811,189	111,907,835.27	4.51
6	603019	中科曙光	3,000,354	107,652,701.52	4.34
7	002410	广联达	5,149,713	107,165,527.53	4.32
8	300347	泰格医药	2,484,015	106,191,641.25	4.28
9	300122	智飞生物	2,608,628	101,110,421.28	4.07
10	300144	宋城演艺	4,647,250	99,218,787.50	4.00

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	－	－
	其中:政策性金融债	－	－
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	－	－
6	中期票据	－	－
7	可转债(可交换债)	33,679.40	0.00
8	同业存单	－	－
9	其他	－	－
10	合计	33,679.40	0.00

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	128013	洪涛转债	380	33,679.40	0.00

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	1,042,298.35
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	94,826.21
5	应收申购款	1,446,343.59
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	2,583,468.15

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	128013	洪涛转债	33,679.40	0.00

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	2,221,737,337.04
报告期期间基金总申购份额	171,312,445.77
减:报告期期间基金总赎回份额	199,798,336.85
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	2,193,251,445.96

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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内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社会责任股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富社会责任混合型证券投资基金合同》;

3、《汇添富社会责任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、报告期内汇添富社会责任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
2019年1月21日

汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富深证300ETF联接
基金主代码	470068
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月28日
报告期末基金份额总额	58,396,124.67份
投资目标	通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以深证300交易型开放式指数证券投资基金作为其主要投资标的,并不参与目标ETF的管理。本基金主要以一级市场申购的方式投资于目标ETF,获取基金份额净值上涨带来的收益;在目标ETF基金份额二级市场交易流动性较好的情况下,也可以通过二级市场买卖目标ETF的基金份额。
业绩比较基准	深证300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股