汇添富新睿精选灵活配置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	汇添富新睿精选混合		
基金主代码	001816		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016年12月21日		
报告期末基金份额总额	118,649,589.34份		
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过积极主动的资产配置,充分挖掘各大类资产投资机会,力争实现基金资产的中长期稳健增值。		
投资策略	本基金综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素,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、货币市场工具和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,力争实现基金资产的中长期稳健增值。		
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%		
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,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		
下属分级基金的基金简称	汇添富新睿精选混合A	汇添富新睿精选混合C	
下属分级基金的交易代码	001816	002164	
报告期末下属分级基金的份额总额	90,915,207.03份	27,734,382.31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)
	汇添富新睿精选混合A	汇添富新睿精选混合C
1.本期已实现收益	747,389.68	232,958.44
2.本期利润	362,247.17	100,007.72
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0038	0.0027
4.期末基金资产净值	100,276,143.74	30,929,202.10
5.期末基金份额净值	1.103	1.115

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

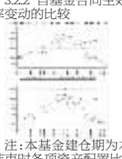
汇添富新睿精选混合A

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	0.36%	0.19%	-5.23%	0.81%	5.59%	-0.62%

汇添富新睿精选混合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	0.27%	0.19%	-5.23%	0.81%	5.50%	-0.62%

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12月21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		
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、汇添富鑫益定开债基金、添富年年益定开混合、添富鑫汇定开债券基金、汇添富睿丰混合基金、汇添富睿鸿选混合基金、添富短债债券基金、添富丰润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。业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员。2012年11月30日至2014年1月7日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014年1月加入汇添富基金,历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理。2014年4月8日至今任汇添富多元收益债券基金的基金经理助理。2015年3月10日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富优选回报混合基金(原理财21天债券基金)的基金经理。2015年3月10日至2018年5月4日任汇添富理财14天债券基金的基金经理。2016年6月7日至今任汇添富货币基金、添富通货币基金、实业债债券基金的基金经理。2016年6月7日至2018年5月4日任理财30天债券基金、理财60天债券基金的基金经理。2017年4月20日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理。2017年5月15日至今任添富年年益定开混合基金的基金经理。2017年6月23日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理。2018年8月2日至今任汇添富睿丰混合基金、汇添富新睿精选混合基金的基金经理。2018年12月13日至今任添富鑫利债券基金的基金经理。2018年12月24日至今任添富丰润中短债基金的基金经理。

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

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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富新睿精选混合A基金份额净值为1.103元,本报告期基金份额净值增长率为0.36%;截至本报告期末汇添富新睿精选混合C基金份额净值为1.115元,本报告期基金份额净值增长率为0.27%;同期业绩比较基准收益率为-5.23%。

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	11,561,039.82	7.15
	其中:股票	11,561,039.82	7.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	143,246,724.70	88.54
	其中:债券	143,246,724.70	88.54
	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	4,528,854.22	2.80
8	其他资产	2,444,641.18	1.51
9	合计	161,781,259.92	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	6,438,066.00	4.91
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	2,351,556.00	1.79
G	交通运输、仓储和邮政业	68,616.30	0.05
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	2,615,994.00	1.99
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	86,807.52	0.07
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		11,561,039.82	8.81

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组合。

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	601166	兴业银行	175,100	2,615,994.00	1.99
2	600298	安琪酵母	94,800	2,391,804.00	1.82
3	601933	永辉超市	298,800	2,351,556.00	1.79
4	600426	华鲁恒升	170,600	2,059,142.00	1.57
5	002179	中航光电	59,000	1,987,120.00	1.51
6	601828	美凯龙	7,863	86,807.52	0.07
7	603056	德邦股份	4,146	68,616.30	0.05

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	12,030,000.00	9.17
	其中:政策性金融债	12,030,000.00	9.17
4	企业债券	119,353,100.00	90.97
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,157,000.00	7.74
7	可转债(可交换债)	1,706,624.70	1.30
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	143,246,724.70	109.18

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	180404	18农发04	120,000	12,030,000.00	9.17
2	143570	18兵团01	110,000	11,176,000.00	8.52
3	143414	17兴沪03	100,000	10,381,000.00	7.91
4	143789	18中车G1	100,000	10,261,000.00	7.82
5	143355	17国投01	100,000	10,188,000.00	7.76

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:本报告期末本基金无股指期货持仓。

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。

5.7 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:报告期末本基金无股指期货持仓。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

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	40,958.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,275,791.05
5	应收申购款	127,891.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,444,641.18

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	132006	15国资EB	1,245,036.70	0.95

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不存在流通受限股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富新睿精选混合A	汇添富新睿精选混合C
报告期期初基金份额总额	98,549,442.81	39,561,829.26
报告期期间基金总申购份额	1,308,928.35	3,341,085.11
减:报告期期间基金总赎回份额	8,943,164.13	15,168,532.06
报告期期末基金份额总额	90,915,207.03	27,734,382.31

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、中国证监会批准汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富新睿精选灵活配置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、报告期内汇添富新睿精选灵活配置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

汇添富鑫利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

基金简称	汇添富鑫利债券		
基金主代码	003532		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017年3月13日		
报告期末基金份额总额	200,100,374.41份		
投资目标	在追求本金安全的基础上,本基金力争创造超越业绩比较基准的较高稳健收益。		
投资策略	本基金将密切关注债券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,自上而下决定类属资产配置及组合久期,并依据内部信用评级系统,深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略等。在谨慎投资的基础上,力争实现组合的稳健增值。		
业绩比较基准	中债综合指数		
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	汇添富鑫利债券A	汇添富鑫利债券C	
下属分级基金的交易代码	003532	003533	
报告期末下属分级基金的份额总额	200,068,475.03份	31,899.38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)
	汇添富鑫利债券A	汇添富鑫利债券C
1.本期已实现收益	2,306,138.77	348.20
2.本期利润	2,742,448.01	419.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0137	0.0125
4.期末基金资产净值	215,505,073.39	34,108.37
5.期末基金份额净值	1.0772	1.0692

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

汇添富鑫利债券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	1.30%	0.03%	1.99%	0.05%	-0.69%	-0.02%

汇添富鑫利债券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	1.18%	0.03%	1.99%	0.05%	-0.81%	-0.02%

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3月13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		
吴江宏	汇添富可转换债券基金、汇添富盈安保本混合基金、汇添富盈稳保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富鑫利债券基金、汇添富鑫绝对收益定开混合、汇添富鑫益定开债、汇添富鑫汇定开债券基金、汇添富民丰回报混合、汇添富鑫永定开债、汇添富鑫盛定开债、汇添富年年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。	2017年3月13日	-	7年	国籍:中国。学历:西南财经大学经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2009年至2012年期间任职于华泰联合证券固定收益部,担任自营交易员职务;2012年11月加盟银华基金管理有限公司,曾担任研究员、基金经理助理职务,自2015年1月29日至2016年10月18日任银华增强收益债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金和银华永泰积极债券型证券投资基金基金经理。2015年5月14日至2016年10月18日任银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年5月21日至2016年10月18日任银华稳利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年11月加入汇添富基金管理股份有限公司任投资经理。2017年4月25日至2017年7月2日任添富年年泰定开混合基金、汇添富鑫瑞债券基金的基金经理助理,2017年7月3日至今任添富年年泰定开混合基金、汇添富鑫瑞债券基金的基金经理。2018年2月13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16日至今任添富鑫盛定开债基金的基金经理,2018年7月6日至今任汇添富鑫汇定开债券基金的基金经理,2017年9月27日至今任汇添富民丰回报混合基金的基金经理。2018年1月25日至今任添富鑫永定开债基金的基金经理,2018年4月16日至今任添富鑫盛定开债基金的基金经理,2018年9月28日至今任添富年年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。
陆文磊	汇添富增强收益债券基金、汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富纯债(LOF)基金汇添富鑫瑞债券基金、添富鑫泽定开债基金的基金经理,总经理助理、固定收益投资总监。	2016年12月26日	-	16年	国籍:中国。学历:华东师范大学金融学博士。相关业务资格:基金从业资格。从业经历:曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。2007年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任总经理助理、固定收益投资总监。2008年3月6日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理。2009年1月21日至2011年6月21日任汇添富货币基金的基金经理。2011年1月26日至2013年2月7日任汇添富保本混合基金的基金经理。2012年7月26日至今任汇添富季季红定期开放债券基金的基金经理。2013年11月6日至今任汇添富纯债(LOF)基金(原汇添富互利分级债券基金)的基金经理。2013年12月13日至2015年3月31日任汇添富全额宝货币基金的基金经理。2014年1月21日至2015年3月31日任汇添富收益快钱货币基金的基金经理。2014年12月23日至2018年5月4日任汇添富收益快钱货币基金的基金经理。2016年12月26日至今任汇添富鑫瑞债券基金的基金经理。2017年4月14日至今任添富年年泰定开混合基金的基金经理。2018年3月8日至今任添富鑫泽定开债基金的基金经理。

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

四季度经济下行压力加大,融资供需两弱,通胀逐步证伪。生产疲弱,工业生产增速震荡下行,其中汽车制造业压力较大,11月工业企业利润单月同比年内首现负增。投资平稳回升,其中地产增速小幅下滑,制造业投资小幅走高,基建企稳回升。需求显著走弱,社零增速下滑幅度明显。抢出口等因素开始出现消退,进出口增速冲高后双双大幅下滑,呈现一定"衰退性顺差"的特征。短期扰动因素退却,通胀如期回落,PPI持续下行。政策着力于解决民企融资难问题,央行创设TMLF对金融机构定向降息。中央经济工作会议确立明年经济工作的重点是强化逆周期调节。货币政策保持偏松基调,重点改善货币政策传导机制,财政政策将是明年逆周期政策的主要看点。

四季度债券收益率普遍下行,收益率曲线呈"牛平"形态,其中1Y国债收益率下行37bp至2.60%,10Y国债收益率下行38bp至3.23%。信用债利率也普遍下行,期限利差和信用利差均有所压缩。

报告期内,组合适度提高组合久期和杠杆,主要配置高等级信用债和利率债。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富鑫利债券A基金份额净值为1.0772元,本报告期基金份额净值增长率为1.30%;截至本报告期末汇添富鑫利债券C基金份额净值为1.0692元,本报告期基金份额净值增长率为1.18%;同期业绩比较基准收益率为1.99%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	201,069,000.00	93.09
	其中:债券	201,069,000.00	93.09
	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	8,000,000.00	3.70
	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	398,444.98	0.18
8	其他资产	6,516,620.63	3.02
9	合计	215,984,065.61	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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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	111,049,000.00	51.52
	其中:政策性金融债	111,049,000.00	51.52
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)	-	-
8	同业存单	76,830,000.00	11.98
9	其他	-	-
10	合计	5,541,439,000.00	98.07

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	180211	18国开11	11,000,000	1,114,630,000.00	19.73
2	180208	18国开08	5,400,000	549,882,000.00	9.73
3	180212	18国开12	5,000,000	505,500,000.00	8.95
4	180406	18农发06	3,900,000	417,027,000.00	7.38
5	180205	18国开05	3,700,000	403,152,000.00	7.13

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国债期货持仓。

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

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	-
4	应收利息	6,516,620.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,516,620.63

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不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富鑫利债券A	汇添富鑫利债券C
报告期期初基金份额总额	200,070,402.95	33,820.88
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	1,927.92	1,921.50
报告期期末基金份额总额	200,068,475.03	31,899.38

注:总申购份额含红利再投份额。

§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	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	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12月31日	200,026,000.00	-	-	200,026,000.00	99.96	
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,执行相关投资策略,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鑫利债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富鑫利债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富鑫利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、报告期内汇添富鑫利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

汇添富鑫瑞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:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月21日

§1 重要提示

基