汇添富盈润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	添富盈润混合
基金主代码	004946
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月6日
报告期末基金份额总额	91,533,703.52份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的管理,追求基金资产的长期稳定回报。
投资策略	本基金在保证资产配置符合基金合同规定的前提下,采用CPPI(Constant Proportion Portfolio Insurance)恒定比例组合保险策略来实现本金保值和增值的目标。CPPI策略主要根据市场的波动来调整,修正风险类资产的风险乘数,以确保投资组合在一段时间以后的价值不低于事先设定的某一目标价值,从而达到投资组合保值增值的目的。投资过程中,基金管理人将在风险类资产投资风险加大和收益预期较两者之间寻找适当的平衡点,即确定适当的风险乘数,力求既能够保证投资组合风险可控,又能够尽量地为投资者创造更多收益。 本基金的投资策略主要包含资产配置策略、债券投资策略和股票投资策略等。
业绩比较基准	3*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	中国建设银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	添富盈润混合A	添富盈润混合C
下属分级基金的交易代码	004946	004947
报告期末下属分级基金的份额总额	82,208,327.44份	9,325,376.08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)
	添富盈润混合A	添富盈润混合C
1.本期已实现收益	1,615,786.96	186,737.48
2.本期利润	354,512.19	33,096.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.0041	0.0032
4.期末基金资产净值	86,434,904.40	9,708,700.74
5.期末基金份额净值	1.0514	1.0411

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 本报告期添富盈润混合A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	0.45%	0.20%	-0.90%	0.32%	1.35%	-0.12%

添富盈润混合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	0.36%	0.20%	-0.90%	0.32%	1.26%	-0.12%

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《基金合同》生效之日为2017年9月6日,本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2017年9月6日)起6个月,建仓期结束时各项资产配制比例符合合同约定。

§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		
何旻	汇添富安心中国债券基金、汇添富6月红定期开放债券基金、汇添富盈鑫保本混合基金、汇添富美元债债券(QDII)基金、添富添福吉祥混合基金、添富盈润混合基金、汇添富弘安混合基金、添富配售基金的基金经理。	2017年9月6日	-	20年	国籍:中国。学历:英国伦敦政治经济学院金融经济学硕士。相关业务资格: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:曾任国泰基金管理有限公司行业研究员、综合研究小组负责人、基金经理助理,固定收益部负责人;金元比联基金管理有限公司基金经理。2004年10月28日至2006年11月11日担任国泰金龙债券基金的基金经理,2005年10月27日至2006年11月11日担任国泰金象保本基金的基金经理,2006年4月28日至2006年11月11日担任国泰金鑫保本基金的基金经理。2007年8月15日至2010年12月29日担任金元比联宝石动力双利债券基金的基金经理,2008年9月3日至2009年3月10日担任金元比联成长动力混合基金的基金经理,2009年3月29日至2010年12月29日担任金元比联丰利债券基金的基金经理。2011年1月加入汇添富资产管理(香港)有限公司,2012年2月17日至今任汇添富人民币债券基金的基金经理。2012年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,2013年11月22日至今任汇添富安心中国债券基金的基金经理,2014年1月21日至今任汇添富6月红定期开放债券基金(原汇添富信用债债券基金)的基金经理,2016年3月11日至今任汇添富盈鑫保本混合基金的基金经理,2017年4月20日至今任汇添富美元债债券(QDII)基金的基金经理,2017年7月24日至今任添富添福吉祥混合基金的基金经理,2017年9月16日至今任添富盈润混合基金的基金经理,2017年9月29日至今任汇添富弘安混合基金的基金经理,2018年7月5日至今任添富配售基金的基金经理。
胡昇伟	汇添富消费行业混合基金、添富添福吉祥混合基金、添富盈润混合基金、添富价值创造定开混合、添富全球消费混合(QDII)基金、添富消费升级混合基金的基金经理。	2017年9月20日	-	7年	国籍:中国。学历:清华大学工学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2011年加入汇添富基金任行业分析师。2016年4月8日至今任汇添富消费行业混合基金的基金经理,2017年7月20日至今任添富添福吉祥混合基金的基金经理,2017年9月20日至今任添富盈润混合基金的基金经理,2018年1月19日至今任添富价值创造定开混合基金的基金经理,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9月,CPI达到2.5%后,逐月回落。去除了食品和能源价格之后的核心CPI在第四季度基本持平,并低于第三季度的平均水平。市场对于通胀的忧虑逐渐消除。PPI的走势下降速度较快,在11月到达今年年内的最低点2.70%。中国制造业采购经理指数PMI在12月回落至50荣枯线以下,只有49.4,其中新订单和生产两个分项指数都有所下降,新订单指数在12月跌至49.7。宏观基本面数据在第四季度基本呈现疲弱的趋势。投资数据方面,房地产投资的同比增速略有回落,而制造业投资累计同比增速全年基本呈现反弹走势。总体的固定资产投资累计同比增速在第四季度小幅上升。从房地产的细项数据上看,70个大中城市商品房价格指数在4月份的最低点持续反弹,12月份同比涨幅达到10.30,与2017年3月份涨幅相同,但是商品房销售额、销售面积都在回落,新开工面积的累计同比增速基本持平。货币政策方面,第四季度央行通过公开市场操作净投放货币4500亿元。各期限逆回购利率与第三季度不变。M1和M2同比增速都回到了2014年1月以来的历史低位。整个债券市场的资金在第四季度较为宽松,只是在个别月底短暂出现资金利率上升的情况。人民币兑美元汇率在第四季度先贬后升,年末基本和上季末汇率持平。第四季度各月份的外汇占款增加额在各个月份均为负值。

在第四季度,债券市场在资金面宽松、经济基本面预期疲弱以及通货膨胀预期缓解的局面下,收益率一路下行。只是在11月末和12月中旬由于一些较弱的因素扰动,收益率短暂向上小幅反弹。中债综合财富指数上涨2.67%。月度表现上,第四季度的3个月都获得正回报。股票市场第四季度沪深300指数下跌12.45%。

本基金在第四季度,主要是买入长期利率债券和信用债券,增加了组合中债券的久期,并且提高了组合的杠杆。股票方面,降低股票比例,年末没有股票仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末添富盈润混合A基金份额净值为1.0514元,本报告期基金份额净值增长率为0.45%;截至本报告期末添富盈润混合C基金份额净值为1.0411元,本报告期基金份额净值增长率为0.36%;同期业绩比较基准收益率为0.32%。

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	109,899,200.30	96.48
	其中:债券	109,899,200.30	96.48
	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	1,038,734.23	0.91
8	其他资产	2,967,640.36	2.61
9	合计	113,905,574.89	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。

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	7,322,250.00	7.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	24,376,400.00	25.35
	其中:政策性金融债	20,338,000.00	21.15
4	企业债券	77,631,746.50	80.75
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	568,803.80	0.59
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	109,899,200.30	114.31

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	180210	18国开10	100,000	10,313,000.00	10.73
2	180404	18农发04	100,000	10,025,000.00	10.43
3	112605	17光线01	80,000	8,112,000.00	8.44
4	143731	18金阳01	60,000	6,103,800.00	6.35
5	136417	16万达02	60,000	5,995,200.00	6.24

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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	15,604.52
2	应收证券清算款	980,041.10
3	应收股利	-
4	应收利息	1,956,283.62
5	应收申购款	15,711.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,967,640.36

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:本基金本报告期末未持有股票投资。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	添富盈润混合A	添富盈润混合C
报告期期初基金份额总额	90,923,806.60	11,153,772.78
报告期期间基金总申购份额	631,918.62	425,494.19
减:报告期期间基金总赎回份额	9,347,396.78	2,253,890.89
报告期期末基金份额总额	82,208,327.44	9,325,376.08

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盈润混合型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富盈润混合型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富盈润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、报告期内汇添富盈润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

汇添富智能制造股票型证券投资基金

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	添富智能制造股票
基金主代码	006802
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年4月23日
报告期末基金份额总额	6,201,572,345.81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,重点投资于智能制造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	本基金为股票型基金。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智能制造相关上市公司。
业绩比较基准	中证智能制造主题指数收益率*80%+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,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金将投资港股通标的股票,将面临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10月1日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-220,530,240.71
2.本期利润	-708,196,222.38
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1129
4.期末基金资产净值	5,316,361,448.05
5.期末基金份额净值	0.8573

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。

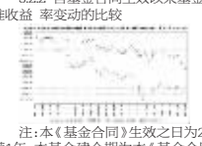
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-11.61%	1.46%	-10.82%	1.60%	-0.79%	-0.14%

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《基金合同》生效之日为2018年4月23日,截至本报告期末,基金成立未满1年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2018年4月23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		
赵鹏飞	汇添富多策略定开混合、汇添富高端制造股票基金、汇添富民丰回报混合基金、汇添富弘安混合基金、汇添富睿丰混合基金、汇添富安增益定开混合基金、添富智能制造股票基金的基金经理。	2018年4月23日	-	10年	国籍:中国。曾任职于日信证券、光大证券和太平洋资产,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日至今任汇添富民安增益定开混合基金的基金经理,2018年4月23日至今任添富智能制造股票基金的基金经理。

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

A股市场四季度大幅下跌。四季度上证50下跌12.03%,沪深300下跌12.45%,中小板指下跌18.22%,创业板指下跌11.39%。三季度末A股反弹之后,国庆期间随着美国副总统讲话,投资者对中美对抗的担忧加剧。与此同时,中国宏观经济数据明显变差,市场对未来经济下滑担忧加剧。四季度蓝筹股与中小股票无一幸免,均大幅下跌。行业来看,采掘钢铁等宏观经济相关度高的行业跌幅最大,农林牧渔跌幅最小。

本基金在十月份完成建仓。仓位始终维持在契约要求的最低仓位,行业相对分散,个股适度集中,主要配置在金融、食品饮料、医药、采掘和高端制造板块。

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0.8573元;本报告期基金份额净值增长率为-11.61%,业绩比较基准收益率为-10.82%。

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	4,274,531,148.93	80.05
	其中:股票	4,274,531,148.93	80.05
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	753,486,913.56	14.11
8	其他资产	12,757,566.67	0.24
9	合计	5,339,704,397.55	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929,720,740.60元,占期末净值比例17.49%。

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	673,991,945.23	12.68
C	制造业	1,290,053,823.01	24.27
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	39,563,417.10	0.74
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	851,410,238.54	16.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	187,838,804.00	3.53
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	502,608.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	301,449,572.45	5.67
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,344,810,408.33	62.92

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	3,132,415.00	0.06
C 消费者常用品	197,159,720.16	3.71
D 能源	310,527,417.93	5.84
E 金融	237,487,701.36	4.47
F 医疗保健	49,733,112.00	0.94
G 工业	131,680,374.15	2.48
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	929,720,740.60	17.50

注:(1)以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

(2)由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	600872	中炬高新	11,505,303	338,946,226.38	6.38
2	002044	美年健康	20,163,851	301,449,572.45	5.67
3	601225	陕西煤业	39,325,182	292,579,354.08	5.50
4	600036	招商银行	11,205,800	282,386,160.00	5.31
5	01088	中国神华	17,809,000	267,768,857.93	5.04
6	000001	平安银行	28,149,673	264,043,932.74	4.97
7	600887	伊利股份	11,345,117	259,576,276.96	4.88
8	601318	中国平安	4,300,000	241,230,000.00	4.54
9	03968	招商银行	9,444,000	237,487,701.36	4.47
10	02319	蒙牛乳业	9,222,000	197,159,720.16	3.71

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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	11,445,232.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	380,355.05
5	应收申购款	931,979.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,757,566.67

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	添富盈润混合A	添富盈润混合C
报告期期初基金份额总额	90,923,806.60	11,153,772.78
报告期期间基金总申购份额	631,918.62	425,494.19
减:报告期期间基金总赎回份额	9,347,396.78	2,253,890.89
报告期期末基金份额总额	82,208,327.44	9,325,376.08

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盈润混合型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富盈润混合型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富盈润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、报告期内汇添富盈润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

汇添富中证500指数型发起式证券投资基金(LOF)

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:招商证券股份有限公司
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。

基金托管人招商证券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	汇添富中证500指数
基金主代码	501036
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年8月10日
报告期末基金份额总额	257,055,748.07份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法,按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,以更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

下属分级基金的基金简称	汇添富中证500指数(LOF)A	汇添富中证500指数(LOF)C
下属分级基金的场内简称	中证500A	中证500C
下属分级基金的交易代码	501036	501037
报告期末下属分级基金的份额总额	157,933,669.13份	99,122,078.94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