汇添富安心中国债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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
送出日期:2019年03月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富安心中国债券	
基金主代码	000396	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年11月22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	
报告期末基金份额总额	221,443,637.61份	
基金合同存续期	不定期	
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
下属分级基金的交易代码	000396	000396
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

2.2 基金产品说明

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于高信用等级债券,力争实现资产的稳健增值。
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80%,其中投资于高等级信用债券的投资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,起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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	田青
	联系电话	021-28932888	010-67595096
	电子邮箱	service@99fund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-9918	010-67595096
传真		021-28932998	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年		2017年		2016年	
	汇添富安心中国债券A	汇添富安心中国债券C	汇添富安心中国债券A	汇添富安心中国债券C	汇添富安心中国债券A	汇添富安心中国债券C
本期实现收益	5,876,848.32	688,181.84	5,124,754.88	207,051.49	8,959,888.85	916,338.46
本期利润	11,223,646.09	721,407.45	1,821,549.79	36,574.57	1,764,141.72	88,767.71
加权平均基金份额本期利润	0.0616	0.0520	0.0114	0.0046	0.0087	0.0038
本期基金份额净值增长率	5.28%	7.50%	0.96%	0.61%	0.53%	0.18%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	0.2090	0.2245	0.1560	0.1468	0.1446	0.1398
期末基金资产净值	233,535,980.41	36,536,875.27	183,763,860.10	5,607,787.87	185,717,607.14	13,250,102.79
期末基金份额净值	1.217	1.233	1.156	1.147	1.145	1.140

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、上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(例如:基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

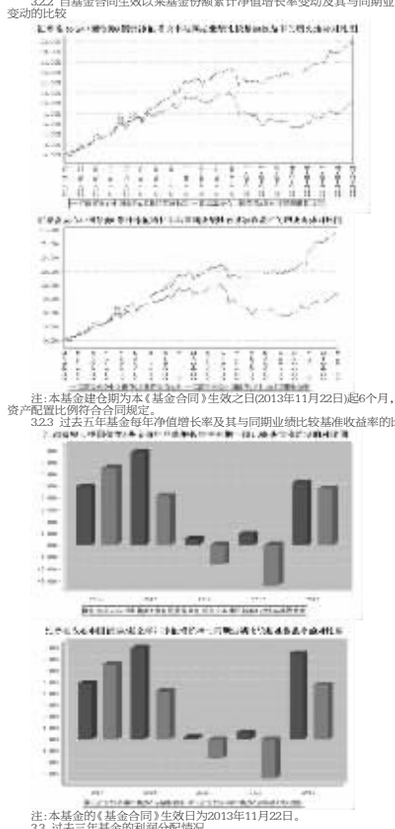
汇添富安心中国债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.50%	0.06%	1.99%	0.05%	-0.49%	0.01%
过去六个月	2.96%	0.06%	2.57%	0.06%	0.39%	0.00%
过去一年	5.28%	0.05%	4.79%	0.07%	0.49%	-0.02%
过去三年	6.85%	0.06%	-0.41%	0.08%	7.26%	-0.02%
过去五年	20.97%	0.07%	10.55%	0.09%	10.42%	-0.02%
自基金合同生效起至今	21.70%	0.07%	10.40%	0.09%	11.30%	-0.02%

汇添富安心中国债券C

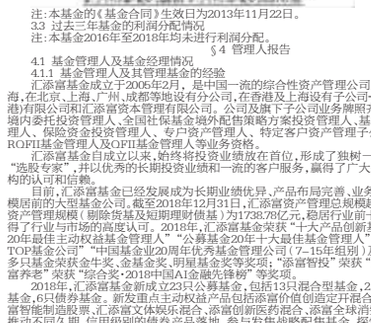
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.48%	0.05%	1.99%	0.05%	-0.51%	0.00%
过去六个月	3.01%	0.06%	2.57%	0.06%	0.44%	0.00%
过去一年	7.50%	0.15%	4.79%	0.07%	2.71%	0.08%
过去三年	8.35%	0.11%	-0.41%	0.08%	8.76%	0.03%
过去五年	22.69%	0.10%	10.55%	0.09%	12.14%	0.01%
自基金合同生效起至今	23.30%	0.09%	10.40%	0.09%	12.90%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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(2013年11月22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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金的《基金合同》生效日为2013年11月22日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金2016年至2018年均未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于2005年2月,是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设在上海,在北京、上海、广州、成都等地设有分公司,在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全,拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人及QFII基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来,始终将投资业绩放在首位,形成了独树一帜的品牌优势,被誉为"选股专家",并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务,赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

目前,汇添富基金已经发展成为长期业绩优异、产品布局完善、业务领域全面、资产管理规模居前的大型基金公司。截至2018年12月31日,汇添富资产管理总规模超过6500亿元,其中公募资产管理规模(剔除货基及短期理财债基)为1738.78亿元,稳居行业前十。优秀的产品及服务赢得了行业与市场的高度认可。2018年,汇添富基金荣获"十大产品创新基金公司奖""公募基金20年最佳主动权益基金管理人""公募基金20年十大最佳基金管理人""基金20年'金基金'TOP基金公司""中国基金业20周年优秀基金管理公司(7-15年组别)及管理层"等奖项,旗下多只基金荣获金牛奖、金基金奖、明星基金奖等奖项;"添富智投"荣获"上海金融创新奖"、"添富养老"荣获"综合奖·2018中国A级金融先锋榜"等奖项。

2018年,汇添富基金新成立23只公募基金,包括13只混合型基金,2只股票型基金,2只指数基金,6只债券基金。新发重点主动权益产品包括添富价值创造定开混合、添富行业整合混合、添富智能制造股票、汇添富文体娱乐混合、添富创新医药混合、添富全球消费混合(QDII)等,有序推动不同久期、信用级别的债券产品落地,参与发售战略配售基金,探索养老目标日期FOF基金。2018年底,公司公募基金产品总数达120只,包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2018年,汇添富基金进一步夯实自有平台基础建设,在全方位升级平台架构及安全系统的基础上,不断引领行业创新,规模及客户数均处于行业领先水平。全年实现指纹识别、人脸识别、常用设备保护、7*24小时智能交易监控等重大升级;推出多款树立行业标杆的拳头功能:指数宝、理财日历、模拟组合、实时估值等。与此同时,互联网金融对外合作业务取得重大突破,与多家互联网巨头达成深度战略合作。截至年底,对外合作伙伴数量已超110家,成为业内对外合作最多的公司之一。

2018年,汇添富基金持续推进大机构战略,机构业务规模保持较好的增长势头。公司深受专业机构投资者信任,获得所有大型银行及保险委外专户组合,且保险委托管理规模同业排名第一。养老金业务方面,公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格,也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务规模快速增长,受托管理组合账户数量及规模持续增加。

2018年,公司积极开展渠道销售和培训工作,专业的投顾服务以及良好的渠道维护口碑不断提升汇添富品牌在渠道影响力和认可度。同时公司持续大力开展定投、投资者教育、添富论坛等系列客户活动,营销培训活动拓展到银行和券商的网点、营业部。

2018年,汇添富基金继续提升客户服务能力,全方位优化客户服务体系。公司通过完善大客户平台建设,搭建了囊括投顾式服务、基金理财、高端客户、现金宝的全新客服体系,为公司各项销售业务提供全方位支持。同时,持续优化电话、在线客服、短信系统等服务通道建设,丰富服务渠道,提高客服体验。

2018年,香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理继续发挥显著成效,国际业务总资产管理规模取得长足进步。公司海外产品线进一步完善,发行了QDII项下汇添富全球消费行业混合型证券投资基金;港股通项下添富沪港深大盘价值混合基金、添富沪港深优势定开基金。"港股通"类委外专户管理规模继续保持领先,海外主动管理权益资产规模保持行业前列。2018年,香港子公司在加强母公司投研一体化基础上,港股投资及海外债券投资业绩持续优异,汇添富中港策略基金获得晨星三年与五年的五星评级,根据彭博统计在最近三年、五年同类港股基金中业绩均位列第一;汇添富港币债券基金获得晨星三年和五年四星评级。

2018年,汇添富公益事业坚持不懈,连续第十一年开展"可流·孩子"公益助学计划。继2017年公司党委下属的八个党支部和各地"添富小学"建立结对关系后,2018年,各支部纷纷前往相应学校开展回访及支教活动。党员们经过实地探访,了解学校实际困难和发展需求,邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的"添富小学"参加公益服务,并通过向公司员工发售筹款台历,参加"99公益日"筹款、参与"一个鸡蛋的暴走"等活动,全年筹款约8万余元,用于添富小学国学课程筹备及开设、教师培训项目开展、图书室扩充等。

2019年,汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则,进一步加强风险管理能力,提升客户服务水平,推动业务稳步发展,为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
茹奕菡	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、添富添瑞吉祥混合基金、添富盈润混合基金、汇添富弘安混合基金、添富多元收益债券、添富年年泰定开混合、添富年年丰定开混合、添富年年益定开混合、汇添富安鑫智选混合、汇添富6月红定期开放债券的基金经理助理	2018年12月24日	-	3	国籍:中国。学历:中央财经大学学士。相关业务资格:证券投资基金从业资格,特许金融分析师(CFA)。从业经历:2011年7月至2012年6月任中国银行股份有限公司交易员,2012年6月至2016年1月任中国银行股份有限公司投资经理,2016年2月至2017年4月任泰达宏利基金管理有限公司投资经理,2017年5月17日至2017年8月8日任泰达宏利港股通股票基金的基金经理。2018年1月26日至今任添富精和混合、汇添富双利强债券、汇添富双利增强债券、汇添富多元收益债券、添富年年泰定开混合、添富年年丰定开混合、汇添富6月红定期开放债券的基金经理助理,2018年12月24日至今任汇添富安心中国债券的基金经理。
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、添富添瑞吉祥混合基金、添富盈润混合基金、汇添富弘安混合基金、添富多元收益债券、添富年年泰定开混合、添富年年丰定开混合、汇添富6月红定期开放债券的基金经理	2013年11月22日	-	20	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日担任国泰金鹿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20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6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3年封闭期债券(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 管理人对报告期内本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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》,本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》,建立了健全、有效的公平交易制度体系,覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合;涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动;贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括:(1)在研究环节,公司建立了统一的投研平台信息管理系统,公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时,通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平充分信息获取机会。(2)在投资环节,公司针对基金、专户、社保、境外投资分别设立了投资决策委员会,各委员会根据各自议事规则分别召开会议,在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在投权范围内根据投资组合的风格和投资策略,独立制定资产配置计划和组合调整方案,并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。(3)在交易环节,公司实行集中交易,所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式,按照"时间优先、价格优先、比例分配"的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理,严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配,确保交易的公平性。(4)在交易监控环节,公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式,对投资交易全过程实施监督,对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。(5)在报告分析方面,公司按季度和年度编制公平交易分析报告,并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。同时,投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

4.3.2 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。报告期内,本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度,进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、清算,以及稽核监察等相关部门组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控,确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内,公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下(日内、3日、5日)同向交易的样本,根据95%置信区间下差价率的T检验显著程度,差价率均值是否小于1%,同向交易占优比等方面进行综合分析,未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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13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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年全年宏观经济运行平稳,国内生产总值逐季小幅下降。全年消费物价指数CPI基本运行在低位,2月份达到全年高点后,到第三季度略有反弹,整体呈现M型走势。去除了食品和能源价格之后的核心CPI基本在2.0%上下窄幅波动。上半年的生产物价指数PPI在上半年反弹到高点4.70%之后,下半年基月回落至2016年9月以来的低点。这一趋势与中国制造业采购经理指数PMI指数趋势方向基本一致。PMI指数从年初低点反弹至5月份的高点后下跌,在12月份回到荣枯线50以下,其中的生产分项指数和新订单指数都呈现相同走势。投资数据方面,固定资产投资累计同比涨幅全年呈现下降趋势,房地产投资累计同比涨幅较2017年有所上升,但是基本处于10%上下水平。制造业投资累计同比增速全年处于上升趋势。民间固定资产投资累计同比增速较为平稳,维持在8.7%左右。从房地产的细项数据上看,70个大中城市商品房价格指数有上升趋势,这可能也促使了房屋新开工面积累计同比增速的反弹。但从销售额、销售面积来看,仍然处于一个下降的通道中。货币政策方面,央行四次宣布调降人民币存款准备金率,并通过中期借贷便利MLF来向市场投放货币。M1同比增速仍然在下降,年底12月份回到2014年以来的最低点。M2同比增速有数月下探到8.0%,创下历史低点。整个债券市场在上半年呈现资金宽松的局面,只是在个别月底短暂出现资金紧张局面。人民币兑美元汇率呈现先升后贬再升值的走势。美元自4月份开始维持强势,持续升值至10月,之后随着对美联储加息预期的下降,开始贬值。

2018年债券市场受到降准政策的刺激、经济基本面的预期,以及资金面宽松等因素的影响,中债综合财富指数上涨2.22%。全年基本呈现单边上扬的走势,在5月、8月和12月期间出现回调。

本基金全年主要是对组合进行久期管理,调整组合的静态收益水平,并且以中长期的利率债进行波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富安心中国债券A基金份额净值为1.217元,本报告期基金份额净值增长率为5.28%;截至本报告期末汇添富安心中国债券C基金份额净值为1.233元,本报告期基金份额净值增长率为7.50%,同期业绩比较基准收益率为4.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年,中国目前处于经济下行周期中,叠加中美贸易摩擦等外部因素的影响,中国GDP增速预计继续回落。2018年,央行全年四次调低人民币存款准备金率,并且多次开展MLF或者TMLF来向市场注入流动性。这也是向市场传递明确的宽松信号,对提振投资者信心有积极作用。并且,在"逆周期调节"的要求下,货币政策将在较长时间内保持流动性的合理充裕。中性宽松的货币政策几乎已经是2019年的基调。目前看来,今年市场预期央行可能继续实施降准和定向降准、MLF、PSL、再贷款等结构性货币政策工具也仍将频繁使用,以实现疏通货币政策向信用投放的传导,金融市场对实体经济的服务。M2增速预计将逐步有所企稳,社会融资量一季度低位徘徊,而后在各方政策的刺激下,出现企稳并且微弱反弹。债券市场可能会呈现窄幅震荡,收益率小幅下行,存在利用息差通过杠杆获取复息的机会。

货币政策维持宽松的环境下,政府层面的实际面因仍是进一步疏通货币政策传导机制和修复融资渠道。从2018年下半年开始,政府推出一系列政策,比如资管新规过际放松、地方专项债加快发行、民企纾困政策,但是社融、M2等增速仍然在持续下行。因此,疏通货币政策传导机制、修复融资渠道成为宽信用的重点。

宽信用当前的几个要素中,货币政策已经具备足够的条件,但联系金融机构和融资主体之间的传导却困难重重。一方面,金融机构受制于资产质量和考核约束,具有天然偏向国企放贷的特点,对民企放贷的意愿相对较低;另一方面,前几年重要的融资传导渠道表外融资在2018年受到了强烈压制,目前对于表外业务需要重建规范和明确其存在意义。对于融资主体来说,地方政府、城投公司融资受制于隐性债务控制和清理的约束,而房地产融资仍处于高压状况,需要观测政策调整判断方向。

在2019年宽信用政策是否见效,何时能见效需要观察。现在融资主体的融资需求已经在主动收缩,仅靠货币政策的宽松,那么会使债市资金利率继续降低,这对债市是利好的一面。在未来,对债市有重要影响的方面,在于观察政府是否能通过政策调整,运用激发融资主体活力、打通融资渠道和鼓励金融机构向民企扩张信贷等措施,提升实体经济增长水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则第9,《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同,但具有不同特征的,若协会有特定调整估值方法的通知的,例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,应参照协会通知执行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会,负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议调算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同规定:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的20%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师徐艳、许培菁于2019年3月25日签字出具了安永华明(2019)审字第60466941_B41号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:汇添富安心中国债券型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	10,554,666.26	341,818.35
结算备付金	421,188.28	90,909.09
存出保证金	9,716.27	414.16
交易性金融资产	260,742,965.70	176,392,300.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	260,742,965.70	176,392,300.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	9,500,000.00
应收证券清算款	-	16,568.63
应收利息	5,000,779.06	3,486,877.99
应收股利	-	-
应收申购款	346,594.47	1,789.55
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	277,075,910.04	189,830,667.77
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	6,207,669.32	-
应付赎回款	317,081.62	1,988.27
应付管理人报酬	159,305.21	112,676.62
应付托管费	45,515.79	32,193.33
应付销售服务费	12,208.15	1,979.09
应付交易费用	875.00	175.00
应交税费	21,424.04	-
应付利息	-1,533.88	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	240,509.11	310,007.49
负债合计	7,003,064.36	459,019.80
所有者权益:		
实收基金	221,443,637.61	163,855,429.69
未分配利润	48,629,218.07	25,516,218.28
所有者权益合计	270,072,855.68	189,371,647.97
负债和所有者权益总计	277,075,910.04	189,830,667.77

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.220元,基金份额总额221,443,637.61份,其中下属A类基金份额参考净值1.217元,份额总额191,817,130.14份;下属C类基金份额参考净值1.233元,份额总额29,626,507.47份。

7.2 利润表

会计主体:汇添富安心中国债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	14,566,259.62	4,020,233.85
1.利息收入	9,151,189.60	8,170,450.00
其中:存款利息收入	43,168.38	38,534.24
债券利息收入	9,081,811.47	8,041,820.16
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	26,209.75	90,095.60
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-169,823.34	-680,406.74
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-169,823.34	-680,406.74
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	5,380,023.38	-3,473,682.01
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	204,869.98	3,872.60
减:二、费用	2,621,206.08	2,162,109.49
1. 管理人报酬	1,628,125.54	1,351,687.89
2. 托管费	465,178.75	386,196.54
3. 销售服务费	66,528.89	36,619.22
4. 交易费用	5,093.35	2,809.65
5. 利息支出	145,956.76	32,966.31
其中:卖出回购金融资产支出	145,956.76	32,966.31
6. 税金及附加	24,729.98	-
7. 其他费用	285,592.81	351,829.88
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	11,945,053.54	1,858,124.36

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富安心中国债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	163,855,429.69	25,516,218.28	189,371,647.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,945,053.54	11,945,053.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	57,588,207.92	11,167,946.25	68,756,154.17
其中:1.基金申购款	141,272,067.66	28,342,756.48	169,614,824.14
2.基金赎回款	-83,683,859.74	-17,174,810.23	-100,858,669.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	221,443,637.61	48,629,218.07	270,072,855.68

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	173,886,355.36	25,081,354.57	198,967,709.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,858,124.36	1,858,124.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-10,030,925.67	-1,423,260.65	-11,454,186.32
其中:1.基金申购款	5,673,967.78	824,098.72	6,498,066.50
2.基金赎回款	-15,704,893.45	-2,247,359.37	-17,952,252.82
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	163,855,429.69	25,516,218.28	189,371,647.97

张晖 李骁 雷青松

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富安心中国债券型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2013]1283号文《关于核准汇添富安心中国债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2013年11月22日正式生效,首次设立募集规模为560,946,160.42份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为债券类品种,包括债券(国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、短期融资券、中期票据、债券回购)、银行存款(包括定期存款及协议存款),以及法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类品种。本基金不投资于可转换债券、资产支持证券、可分离债券、中小企业私募债券、债项评级在AA级以下的信用债券以及无信用评级的信用债券,不直接从二级市场上买入股票和权证,也不参与一级市场新股申购。在严格控制风险的基础上,本基金通过深入分析固定收益类金融工具的投资价值并进行主动管理,力争实现资产的长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号《年度报告的内容与格式》》、《证券投资基金信息披露报表模型》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为