

信息披露disclosure

中海添顺定期开放混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

注:证券从业人员的定义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

42 管理人对报告期内本基金净值波动情况的控制情况
基金管理人(在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同)的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为,不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
根据《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等各环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易进行了明确的,公司通过制定研究、交易等相关制度,要求公司各组合研究成果共享,投资交易指令统一下达至交易室,由交易室通过应用公平交易模块并具体执行相关交易,通过公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实;同时,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易,由公司对相关交易价格进行事前审核,风控的事前介入有效的防止了可能出现的公平交易行为。

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相关溢价金额对组合收益的影响进行了重要性分析,并针对对交易占优次数进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更准确、有效。

本报告期,公司根据制度要求,对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析,对于出现的公司制度中规定的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以规避。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,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不存在超过该证券当日成交量5%的情况,对于一级市场证券申购、二级市场证券交易等投资管理活动中可能损害公平交易和利益输送的重大异常交易情况,公司均根据制度要求对相关处理情况予以说明。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
年初开局经济较平稳,物价水平温和,金融数据中社融增量明显超于预期,主要增量来自信贷,外债环境缓和超预期推动房地产市场走强。后续市场能否继续走强有待经济基本面的进一步验证。

习近平主席提出了金融供给侧结构性改革,强调要强化对国际国内金融形势的认识,正确把握金融本质,深化金融供给侧结构性改革,平衡好稳增长和防风险的关系,精准有效处置重点领域风险,深化金融改革开放,增强金融服务实体经济能力,坚决打好防范化解金融风险攻坚战,在防范化解金融风险攻坚战中,推动国内金融基础设施改革,两会期间政府工作报告强调了“改善资本市场金融基础设施”的表述,“提高直接融资比重”成为资本市场供给侧改革的重点,资本市场定位有所提高,科创板设立并逐步成为市场关注的重点。

两会期间政府工作报告首次提到“确保经济在合理区间”,底线思维明确。今年GDP增速预期目标由2018年的6.5%左右进一步下调为6%—6.5%。政府工作报告调高至28%,为应对未来的不确定性预留了政策空间。政府工作报告指出今年全国金融工作会议和社保费划转近20万亿元,通过采取一系列财税措施,确保所有行业税负只减不增。海外市场方面,美国就业会议数据超预期,紧缩措施进一步降低。中美贸易谈判未取得进展,市场对经济平衡的预期进一步提高。

金融市场中,流动性持续宽松和宽松,社融超预期也预期了债券市场走势偏强。权益市场方面,外债环境和超预期推动房地产市场走强。后续市场能否继续走强有待经济基本面的进一步验证。

季度内固定收益资产中以短信用品种为主。

截至2019年3月31日,本基金份额净值1.049元累计净值1.0829元。报告期内本基金净值增长率为1.04%,低于同期业绩比较基准0.6个百分点。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值变动说明
自2019年1月1日至3月31日期间,本基金曾出现超过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

5.1 投资组合报告
5.1.1 基金投资组合情况

5.1.2 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

5.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.1.4 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资产支持证券投资明细

5.1.5 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贵金属投资明细

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.1.7 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.8 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.1.9 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.10 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.11 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.1.13 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.14 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.15 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.16 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.17 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.18 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.19 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.20 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.21 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.22 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.23 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.24 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.25 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.26 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.27 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.28 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.29 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.30 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.31 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.32 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.33 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.34 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.35 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.36 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.37 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.38 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.39 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.40 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.41 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.42 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.43 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.44 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.45 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.46 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.47 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.48 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.49 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.50 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.51 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.52 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.53 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.54 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.55 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.56 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.57 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.58 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.59 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.60 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.61 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.62 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.63 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.64 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.65 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.66 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.67 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.68 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.69 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.70 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.71 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.72 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.73 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.74 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.75 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.76 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.77 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.78 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.79 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.80 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.81 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.82 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.83 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.84 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.85 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.86 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.87 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.88 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.89 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.90 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.91 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.92 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.93 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.94 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.95 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.96 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.97 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.98 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.99 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.100 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.101 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.102 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.103 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.104 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.105 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.106 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.107 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.108 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.109 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.110 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.111 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.112 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.113 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.114 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.115 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.116 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.117 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.118 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.119 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.120 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.121 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.122 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.123 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.124 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.125 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.126 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.127 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.128 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.129 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.130 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.131 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.132 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.133 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.134 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.135 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.136 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.137 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.138 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.139 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.140 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.141 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.142 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.143 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.144 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.145 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.146 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.147 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.148 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.149 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.150 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.151 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.152 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.153 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.154 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.155 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.156 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.157 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.158 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.159 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.160 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.161 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.162 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.163 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.164 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.165 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.166 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.167 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.168 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.169 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.170 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.171 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.172 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.173 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.174 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.175 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.176 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.177 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.178 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.179 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.180 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.181 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.182 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.183 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.184 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.185 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.186 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.187 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.188 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.189 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.190 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.191 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.192 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.193 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.194 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.1.195 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.1.196 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况

5.1.197 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

5.1.198 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细