汇添富短债债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月20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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月18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2019年1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	添富短债债券
基金主代码	006646
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月13日
报告期末基金份额总额	1,573,075,391.37份
投资目标	本基金在严格管理风险的前提下,主要投资短期债券,力求超越业绩比较基准的投资回报。
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。本基金灵活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,力争实现相合的稳健回值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中债总财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,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	兴业银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	添富短债债券A	添富短债债券C
下属分级基金的交易代码	006646	006647
报告期末下属分级基金的份额总额	810,566,351.15份	762,509,040.22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(2019年1月1日-2019年3月31日)	报告期(2019年1月1日-2019年3月31日)
	添富短债债券A	添富短债债券C
1.本期已实现收益	9,697,398.36	14,999,231.70
2.本期利润	9,926,031.74	15,581,831.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0104	0.0099
4.期末基金资产净值	821,096,675.95	771,499,424.58
5.期末基金份额净值	1.0130	1.0118

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

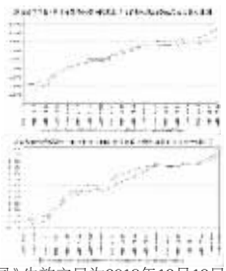
添富短债债券A

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	1.06%	0.02%	0.92%	0.03%	0.14%	-0.01%

添富短债债券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	0.96%	0.02%	0.92%	0.03%	0.04%	-0.01%

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12月13日,截至本报告期末,基金成立未满6个月;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2018年12月13日)起6个月,截止本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

§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	现金宝货币基金、实业债债券基金、优选回报混合基金、汇添富鑫益定开债券基金、添富年年益定开混合、添富鑫汇定开债券基金、汇添富春丰混合(LOF)基金、汇添富新睿精选混合基金、添富短债债券基金、添富丰润中短债基金、汇添富丰利短债基金的基金经理。	2018年12月13日	-	13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:2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强基金的基金经理,2010年9月21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日至今任汇添富鑫益定开债券基金的基金经理,2016年6月7日至2019年1月25日任汇添富货币基金的基金经理,2016年6月7日至今任实业债债券基金的基金经理,2016年6月7日至今任汇添富善丰混合(LOF)基金、汇添富新睿精选混合基金、添富短债债券基金、汇添富丰润中短债基金、汇添富丰利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。
郑慧莹	汇添富双利增强债券、汇添富双利债券、添富年年丰定开混合、汇添富中证500指数增强基金、汇添富6月定开债券、汇添富6月定开混合、汇添富鑫益定开债券基金、汇添富6月定开混合、汇添富丰利短债基金的基金经理,风金管理职总监。	2017年12月26日	-	9年	国籍:中国。学历:复旦大学会计学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。中国注册会计师。从业经历:2010年7月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任行业研究员、高级研究员。2017年6月18日至2017年12月11日任汇添富年年丰定开混合基金和汇添富6月红定开债基金的基金经理助理,2017年6月18日至2017年12月26日任汇添富年年益定开混合基金的基金经理助理。2017年12月12日至今任汇添富双利债券、汇添富双利债券、添富年年丰定开混合、汇添富年年益定开混合、汇添富6月定开混合、汇添富6月红定开混合基金的基金经理。2017年12月26日至今任汇添富年年益定开混合的基金经理,2018年3月13日至今担任汇添富丰利短债基金的基金经理。2018年6月6日至今任汇添富6月定开混合的基金经理。
杨慧强	汇添富双利增强债券、汇添富双利债券、汇添富年年丰定开混合、汇添富中证500指数增强基金、汇添富6月定开混合、汇添富鑫益定开债券基金、汇添富6月定开混合、汇添富丰利短债基金的基金经理。	2018年6月26日	-	8年	国籍:中国。学历:厦门大学经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2010年7月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任行业研究员、高级研究员。2017年6月18日至2017年12月11日任汇添富年年丰定开混合基金和汇添富6月红定开债基金的基金经理助理,2017年6月18日至2017年12月26日任汇添富年年益定开混合基金的基金经理助理。2017年12月12日至今任汇添富双利债券、汇添富双利债券、添富年年丰定开混合、汇添富年年益定开混合、汇添富6月定开混合、汇添富6月红定开混合基金的基金经理。2017年12月26日至今任汇添富年年益定开混合的基金经理,2018年3月13日至今担任汇添富丰利短债基金的基金经理。2018年4月2日至今任汇添富鑫益定开债券基金的基金经理。2018年8月2日至今任汇添富丰润中短债基金(LOF)基金、汇添富新睿精选混合基金的基金经理,2018年12月13日至今任添富双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。2019年1月18日至今任汇添富丰利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2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

一季度宏观经济基本面有所改善:PMI经历了连续3个月低于荣枯线之后超预期反弹至50以上,从分项指标来看新订单和生产订单均有所回升,六大发电集团日均耗煤量等高频数据也表明经济有企稳迹象;CPI和PPI短期内受制于较弱的总需求,并无大幅上涨的基础;央行在货币政策上保持稳健宽松,年初即下调存准率100BP,释放较多的流动性以支持实体企业,货币市场利率较去年四季度继续下行。

一季度债市表现出震荡行情,截止本季度末,1年金融债收益率为2.55%,相比去年末下降约20BP,半年-1年新大额同业存单收益率亦下行40-50BP,而10年期国开债下行幅度仅为5BP,收益率曲线形态陡峭化明显。

考虑到股债跷跷板效应,同时基本面企稳不利于债市,此外组合运作时间较短,对于申赎规律和投资者结构的认知仍处于摸索阶段,短期内仍以控制风险和波动为主,本基金在债券投资策略上较为谨慎,久期控制在1年以内,持仓债券以AA+以上中高等级信用债为主,并兼顾个券的分散化,同时适当运用杠杆以增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末添富短债债券A基金份额净值为1.0130元,本报告期基金份额净值增长率为1.06%;截至本报告期末添富短债债券C基金份额净值为1.0118元,本报告期基金份额净值增长率为0.96%;同期业绩比较基准收益率为0.92%。

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	2,156,421,500.00	97.59
	其中:债券	2,156,421,500.00	97.59
	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	27,226,581.45	1.23
8	其他资产	26,042,227.85	1.18
9	合计	2,209,690,309.30	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:本基金本报告期未持有股票。

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:本基金本报告期未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

注:本基金本报告期未未持有股票。

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	101,660,000.00	6.38
	其中:政策性金融债	101,660,000.00	6.38
4	企业债券	123,211,000.00	7.74
5	企业短期融资券	1,274,139,000.00	80.00
6	中期票据	511,791,500.00	32.14
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	145,620,000.00	9.14
9	其他	-	-
10	合计	2,156,421,500.00	135.40

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	111906095	19交通银行CD095	1,500,000	145,620,000.00	9.14
2	101456074	14豫高管MTN001	1,100,000	111,661,000.00	7.01
3	180202	18国开02	1,000,000	101,660,000.00	6.38
4	011900195	19复星医药SCP001	1,000,000	100,360,000.00	6.30
5	011900176	19中节能SCP001	1,000,000	100,330,000.00	6.30

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: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	44,243.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,053,543.84
5	应收申购款	4,944,440.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,042,227.85

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:本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	添富短债债券A	添富短债债券C
报告期期初基金份额总额	1,041,754,273.10	2,358,870,295.54
报告期期间基金总申购份额	456,247,148.16	195,587,864.82
减:报告期期间基金总赎回份额	687,435,070.11	1,791,949,120.14
报告期期末基金份额总额	810,566,351.15	762,509,040.22

注:其中"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、中国证监会准予汇添富短债债券型证券投资基金注册的文件;

2、《汇添富短债债券型证券投资基金合同》;

3、《汇添富短债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执照;

5、报告期内汇添富短债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4月20日

汇添富多元收益债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

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4月20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4月18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2019年1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富多元收益债券
基金主代码	470010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月18日
报告期末基金份额总额	148,762,267.14份
投资目标	本基金主要投资于债券类固定收益品种,在承担合理风险和保持资产流动性的基础上,适度参与权益类资产投资,力争实现资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将密切关注股票、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,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。在资本债上,本基金将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,综合考察信用债券的信用评级、以收益率水平等、自下而上精挑细选个券,同时,本基金还将通过精选出具有持续竞争优势且估值有吸引力的股票,在严格控制基金资产运作风险的基础上,把握权益市场投资机会,力争实现相合的稳健增值。
业绩比较基准	中债综合指数×90%+沪深300指数×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益水平介于债券型基金和混合型基金,高于货币市场基金。
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	汇添富多元收益债券A	汇添富多元收益债券C
下属分级基金的交易代码	470010	470011
报告期末下属分级基金的份额总额	127,225,210.22份	21,537,056.92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(2019年1月1日-2019年3月31日)	报告期(2019年1月1日-2019年3月31日)
	汇添富多元收益债券A	汇添富多元收益债券C
1.本期已实现收益	3,166,797.02	415,604.48
2.本期利润	11,350,228.87	1,494,862.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0727	0.0727
4.期末基金资产净值	157,205,464.64	26,391,458.33
5.期末基金份额净值	1.236	1.225

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

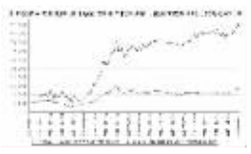
汇添富多元收益债券A

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	6.46%	0.28%	3.29%	0.15%	3.17%	0.23%

汇添富多元收益债券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	6.24%	0.37%	3.29%	0.15%	2.95%	0.22%

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(2012年9月18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		
曾刚	汇添富多元收益、可转换债券、实业债债券、双利增强债券、汇添富交鑫智选混合、汇添富稳健纯利定期开放债券基金、汇添富6月红定期开放债券基金、汇添富鑫益定开债券基金、汇添富保本混合基金、汇添富鑫益保本混合基金、汇添富稳健保本混合基金、汇添富年年益定开混合基金、汇添富双利增强债券基金、汇添富6月定期开放债券基金、汇添富优选回报混合基金、汇添富鑫益保本混合基金、汇添富稳健保本混合基金、汇添富年年益定开混合基金、汇添富鑫益定开债券基金、汇添富6月定期开放债券基金、汇添富鑫益保本混合基金、汇添富稳健保本混合