汇添富民营活力混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示 本基金经2010年3月17日中国证券监督管理委员会证监许可【2010】308号文

根据基金管理人2015年8月5日刊登的《汇添富基金管理股份有限公司关于变 更旗下 "混合型证券投资基金" 的基金名称并相应修订基金合同部分条款的公 告》,汇添富民营活力股票型证券投资基金自2015年8月5日起更名为汇添富民营 活力混合型证券投资基金。(基金简称:汇添富民营活力混合:基金代码:470009)

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证 监会核准 但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益 作出实质性判断或保证,也不表明投资干木基金没有风险

基金管理人依昭恪尽职守,诚实信用,谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产, 但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益

投资者拟认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产 品资料概要等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征,并承担基金投 资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影 赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理 风险,本基金的特定风险,等等。本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平低于 股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。投 资者应充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、 时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自 负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风 险,由投资者自行负责。

本基金更新招募说明书"基金的投资"童节中有关"风险收益特征"的表述是 基于投资范围,投资比例,证券市场普遍规律等做出的概述性描述,代表了一般市 场情况下本基金的长期风险收益特征,销售机构(包括基金管理人直销机构和其他 销售机构)根据相关法律法规对本基金进行"销售适当性风险评价",不同的销售 机构采用的评价方法也不同,因此销售机构的基金产品"风险等级评价"与"基金 的投资"章节中"风险收益特征"的表述可能存在不同,投资人在购买本基金时需 按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金 管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不对 投资者保证基金一定盈利,也不向投资者保证最低收益。

本基金本次更新的招募说明书主要根据《公开募集证券投资基金信息披露管 理办法》和修订后的基金合同对相关信息进行更新,同时对基金管理人、基金托管 人、财务数据和净值表现等其他信息一并更新,更新所载内容截止日为 2020年4月 14日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年12月31日。 一、基金管理人

(一)基金管理人简况

名称: 汇添富基金管理股份有限公司

住所: 上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室 办公地址:上海市富城路99号震日国际大楼20楼 法定代表人:李文

成立时间: 2005年2月3日 批准设立机关:中国证券监督管理委员会

批准设立文号:证监基金字[2005]5号

注册资本:人民币132,724,224元

联系人:李鹏

联系电话:021-28932888 股东名称及其出资比例:

东方证券股份有限公司	35.412%
上海菁聚金投资管理合伙企业(有限合伙)	24.656%
上海上报资产管理有限公司	19.966%
东航金控有限责任公司	19.966%
合计	100%
(二)主要人员情况	

李文先生,2015年4月16日担任董事长。国籍:中国,厦门大学会计学博士。现任 二添富基金管理股份有限公司董事长,汇添富资产管理(香港)有限公司董事长。历 任中国人民银行厦门市分行稽核处科长,中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局 杏林支局副行长、副局长,中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处 长,东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理,稽核总部总经理,东方证 券股份有限公司资金财务管理总部总经理,汇添富基金管理股份有限公司督察长。 程峰先生,2016年11月20日担任董事。国籍:中国、上海交通大学工商管理硕

士。现任上海报业集团副总经理,上海上报资产管理有限公司董事长,上海文化产 权交易所股份有限公司董事长,上海瑞力投资基金管理有限公司董事长。历任上海 市对外经济贸易委员会团委副书记、书记,上海机械进出口(集团)有限公司副总裁 上海市对外经济贸易委员会技术进口处副处长,上海市对外经济贸易委员会科技 发展与技术贸易处副处长、处长,上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任,上 海国际集团有限公司行政管理总部总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委 副书记、总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理,上海 国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长,上海国有资产经营有限公司党委书

林福杰先生,2018年3月21日担任董事。国籍:中国,上海交通大学工商管理硕 十。现任东航金控有限责任公司总经理、党委副书记、东航集团财务有限责任公司 董事长。曾任东航期货有限责任公司部门经理,东航集团财务有限责任公司副总经 理,国泰人寿保险有限责任公司副总经理,东航金控有限责任公司党委书记、副总 经理。

张辉先生,2015年4月16日担任董事,总经理。国籍:中国,上海财经大学经济学 硕士 现任汇添宣其全管理股份有限公司总经理 汇添宣资本管理有限公司董事 长 历任由银万国证券研究所高级分析师 富国其金管理有限公司研究主管和其金 经理,汇添富基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监,曾担任中国证券监督管 理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

博士,加拿大Saskatchewan大学工商管理理学硕士。现任澳门科技大学副校长兼 商学院院长、教授、博导。历任福建省科学技术委员计划财务处会计,五大国际会计 师事务所Touche Ross International(现为德勤) 加拿大多伦多分所审计员,厦门 大学会计师事务所副主任会计师,厦门大学经济学院讲师、副教授,伊利诺大学 (University of Illinois) 国际会计教育与研究中心访问学者,美国斯坦福大学 (Stanford University)经济系访问学者,加拿大Lethbridge大学管理学院会计学讲 师、副教授 (tenured),香港大学商学院访问教授,香港浸会大学商学院会计与法律 系教授,博导,系主任。

士。现任《第一财经日报》副总编辑,第一财经研究院院长,国家金融与发展实验室 特邀高级研究员。上海政协委员、《第一财经日报》创始编委之一、第一财经额道高 端对话节目《经济学人》等栏目创始人和主持人、《波士堂》等栏目资深评论员。 2002-2003年期间受邀成为约翰-霍普金斯大学访问学者

杨燕青女士,2011年12月19日担任独立董事,国籍:中国,复旦大学经济学博

魏尚进(Shangjin Wei)先生,2020年1月9日担任独立董事.国籍:美国 加州 大学伯克利分校博士。现任复旦大学泛海国际金融学院访问教授、哥伦比亚大学终 身讲席教授。曾任哈佛大学肯尼迪政府学院助理教授、副教授,世界银行顾问,国际 货币基金组织工作贸易与投资处处长、研究局助理局长

任瑞良先生,2004年10月20日担任监事,2015年6月30日担任监事会主席。国 籍:中国,大学学历,会计师、非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上报

王如富先生,2015年9月8日担任监事。国籍:中国,硕士研究生,注册会计师。现 任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任。历任申银万国证券计 划统筹总部综合计划部专员、发展协调办公室专员,金信证券规划发展总部总经理 助理、秘书处副主任(主持工作),东方证券研究所证券市场战略资深研究员、董事 会办公室资深主管、主任助理、副主任。

新民联合报业集团文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理等

毛海东先生,2015年6月30日担任监事,国籍:中国,国际金融学硕士。现任东航 金控有限责任公司总经理助理兼财富管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责 任公司,东航集团财务有限责任公司。

王静女士,2008年2月23日担任职工监事,国籍:中国,中加商学院工商管理硕 士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任职于中国东方航空 集团公司宣传部,东航金控有限责任公司研究发展部。 林旋女士,2008年2月23日担任职工监事,国籍:中国,华东政法学院法学硕士。

现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监,汇添富资本管理有限公 司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室 陈杰先生,2013年8月8日担任职工监事,国籍:中国,北京大学理学博士。现任

汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有 3、高管人员

李文先生,董事长。(简历请参见上述董事会成员介绍)

张辉先生,2015年6月25日担任总经理。(简历请参见上述董事会成员介绍) 雷继明先生,2012年3月7日担任副总经理。国籍:中国,工商管理硕士。历任中

国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理,中国民族证券有限责任公司营业 部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011年12月加盟汇添富基金管理股份有限公 司,现任公司副总经理。 娄焱女士,2013年1月7日担任副总经理。国籍:中国,金融经济学硕士。曾在赛

格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、 招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处 工作,负责投资银行、证券投资研究,以及基金产品策划、机构理财等管理工作。 2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理

袁建军先生,2015年8月5日担任副总经理。国籍:中国,金融学硕士。历任华夏 证券股份有限公司研究所行业二部副经理,汇添富基金管理股份有限公司基金经

委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005年4月加入汇添富基金管理股 份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。 李骁先生,2017年3月3日担任副总经理。国籍:中国,武汉大学金融学硕士。历 任厦门建行计算机处副处长,厦门建行信用卡部副处长、处长,厦门建行信息技术

息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任,建总行信息技术管理部资深专员(副 总经理级)。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股 份有限公司副总经理、首席技术官。

李鹏先生,2015年6月25日担任督察长。国籍:中国,上海财经大学经济学博士, 历任上海证监局主任科员、副处长、上海农商银行同业金融部副总经理、汇添富基 全管理股份有限公司稽核监察总监。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公 司,现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。 4、基金经理

(1)现任基金经理

马翔先生,国籍:中国。学历:清华大学工学硕士。9年证券从业经验。从业经历

2011年加入汇添富基金任行业分析师,2016年3月11日至今任汇添富民营活力混合 基金的基金经理,2019年5月6日至今任汇添富科技创新混合基金的基金经理,2020 (2) 历任基金经理

齐东超先生,2010年5月5日至2014年4月8日任汇添富民营活力混合型证券投 资基金的基金经理。

朱晓亮先生,2014年4月8日至2016年3月10日任汇添富民营活力混合型证券 投资基金的基金经理。 5、投资决策委员会

. 基金托管人

主席:袁建军先生(副总经理)

(总经理助理,固定收益投资总监)、劳杰男(研究总监) 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

(一)基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司 注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日 法定代表人: 陈四清 注册资本:人民币35,640,625.71万元

联系人:郭明

(二)主要人员情况

截至2019年9月,中国工商银行资产托管部共有员工208人,平均年龄33岁, 95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者。中国工商银行自1998年在国内首家提供托 管服务以来,秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部 控制体系 抑带的管理模式 先进的营运系统和专业的服务团队 严格履行资产托 管人职责,为境内外广大投资者,会融资产管理机构和企业客户提供安全,高效,专 业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最 成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本 养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产 管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定 客户资产管理、ODII专户资产、ESCROW等门类齐全的杆管产品体系、同时在国内 率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服 务。截至2019年9月,中国工商银行共托管证券投资基金1006只。自2003年以来,本 行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环 球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的68项最 佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金 融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构 (一)基金份额销售机构

1、直销机构 (1)汇添富基金管理股份有限公司直销中心

住所:上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室 办公地址:上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼

法定代表人,李文 由话:(021)28932893

传真:(021)50199035或(021)50199036

联系人:陈卓廧

客户服务电话:400-888-9918(免长途话费

网址:www.99fund.con

(2)汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统(trade.99fund.com

本基金的代销机构请详见基金管理人官网公示的销售机构信息表。基金管理 人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售基金,并在基金 管理人网站公示。

O类基金份额的海外销售机构情况,具体请参见招募说明书补充文件。 (二)注册登记机构

1、A类基金份额注册登记机构 名称: 汇添富基金管理股份有限公司

住所: 上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室 办公地址:上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼

法定代表人,李文

电话:(021)28932888 传真:(021)28932876

联系人:韩从慧

2、O类基金份额注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司 住所:北京市西城区太平桥大街17号

传真:010-58598907

联系人:任瑞新 (三)律师事务所和经办律师

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼 办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:俞卫锋 电话:(021)31358666

传真:(021)31358600

经办律师:吕红、黎明

联系人:陈颖华

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层 邮政编码:100738

执行事务合伙人:毛鞍宁

电话: 010-58153000

传真: 010-85188298

业务联系人:徐艳

经办会计师:徐艳、许培菁

四、基金的名称

基金全称: 汇添富民营活力混合型证券投资基金 基金简称: 汇添富民营活力混合

基金代码:470009 万,基金的类型

本基金为契约型开放式混合型基金

六、基金的投资目标 本基金采用自下而上的方法,精选与中国经济发展密切相关的优秀民营企业

上市公司股票进行投资布局,在科学严格管理风险的前提下,力求基金资产的中长

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的 股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基 金投资的其他金融工具。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种,本 基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%—95%;债券资产、货币 市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证 券品种占基金资产的5%—40%,其中,基金持有全部权证的市值不得超过基金资产 净值的3%,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计 不低于基金资产净值的5%,本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应

本基金以民营企业上市公司为股票主要投资对象,投资于民营企业上市公司 股票的资产占股票资产的比例不低于80%。本基金主要依据上市公司招股说明书、 定期报告和股权变动公告判断该上市公司是否为民营企业上市公司,判断的主要 标准为上市公司实际控制人。实际控制人是实际控制上市公司的自然人、法人或其 他组织,具体而言,只要拥有下列情形之一的,即视为拥有上市公司控制权:投资者 为上市公司持股50%以上的控股股东;投资者可以实际支配上市公司股份表决权超 过30%;投资者通过实际支配上市公司股份表决权能够决定公司董事会半数以上成 员选任;投资者依其可实际支配的上市公司股份表决权足以对公司股东大会的决

本基金将实际控制人为境内自然人(不包括港澳台)控股的上市公司定义为 民营企业上市公司。本基金拟投资的民营企业上市公司股票包括符合本基金定义 的中证民营企业综合指数成份股、新股、发生股权变动后的已上市公司。

当市场出现符合本基金定义的更合适、更权威的表征民营企业上市公司的指 数或中证民营企业综合指数停止发布时,基金管理人有权选用新指数的成份股或 按本基金有关民营企业上市公司的定义自行选择股票来替换中证民营企业综合指

八、基金的投资策略

本基金为混合型基金。股票投资的主要策略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 精选策略用于挖掘成长性较高且估值有吸引力的优秀民营企业上市公司以获取超 额收益。 本基金通过投资于具有良好的公司治理结构, 灵活的用人和分配机制, 独 特的核心竞争优势等突出特征的优秀民营企业,以分享优秀民营企业成长所带来

1、资产配置策略 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(其中,基本

的资本增值。

面因素包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、固定资产 投资总量、发电量等宏观经济统计数据;政策面因素包括存款准备金率、存贷款利 率、再贴现率、公开市场操作等货币政策、政府购买总量、转移支付水平以及税收政 策等财务政策;市场面因素包括市场参与者情绪、市场资金供求变化、市场P/E与历 史平均水平的偏离程度等),结合全球宏观经济形势,研判国内经济的发展趋势,并 在严格控制投资组合风险的前提下,确定或调整投资组合中股票、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的投资比例。 2. 个股精洗策略

首先,按照本基金投资范围的界定,针对沪深两市民营企业上市公司,根据本 基金管理人投资管理制度要求以及股票投资限制,进行初步筛选,组成本基金的初 成员:韩贤旺(首席经济学家)、王栩(总经理助理,权益投资总监)、陆文磊 选股票库 其次,本基金采取定性分析的方法,对初选股票库中的上市公司进行深入分析

> 和调查研究,评估公司的行业特征、经营状况、财务数据、业绩驱动因素、用人和分 配机制等,给出股票综合评级,从中排洗出拥有良好的公司治理结构以确保股东利 益与公司管理层利益的一致和在经营许可、规模、资源、技术、品牌、创新能力等一 个或数个方面具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的核心竞争优势的公司,组 成本基金的精选股票库。 然后,本基金采取定量分析的方法,采用PEG指标来评估企业的投资价值(即

企业未来盈余继续成长的可能性越高、幅度越大、投资者可接受的市盈率PE也越

高;在PEG)0的情况下,PEG数值越小表明企业的估值越有吸引力),从精选股票 库中选择成长性较高、估值有吸引力的公司,组成本基金的核心股票库 本基金的债券投资综合考虑收益性、风险性和流动性,在深入分析宏观经济、

货币政策以及市场结构的基础上,灵活运用各种消极和积极策略。

消极债券投资的目标是在满足现金管理需要的基础上为基金资产提供稳定的 收益。本基金主要通过利率免疫策略来进行消极债券投资。利率免疫策略就是构造 个恰当的债券组合,使得利率变动导致的价格波动风险与再投资风险相互抵消。 这样无论市场利率如何变化,债券组合都能获得一个比较确定的收益率

积极债券投资的目标是利用市场定价的无效率来获得低风险甚至是无风险的

超额收益。本基金的积极债券投资主要基于对利率期限结构的研究。利率期限结构 描述了债券市场的平均收益率水平以及不同期限债券之间的收益率差别。它决定 干二个更要,货币市场利率 均衡直空利率和预期通货膨胀率 在深入分析利率期 限结构的基础上,本基金将运用利率预期策略、收益率曲线追踪策略进行积极投

本基金也将从债券市场的结构变化中寻求积极投资的机会。国内债券市场正 处于发展阶段,交易制度、债券品种体系和投资者结构也在逐步完善,这些结构变 化会产生低风险甚至无风险的套利机会。本基金将借助经济理论和金融分析方法 努力把握市场结构变化所带来的影响,并在此基础上寻求低风险甚至无风险的套

本基金将权证看作是辅助性投资工具,其投资原则为优化基金资产的风险收

益特征,有利于基金资产增值,有利于加强基金风险控制。本基金将在权证理论定

价模型的基础上,综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及

交易制度设计等多种因素,对权证进行合理定价。主要策略为低成本避险和合理杠 杆操作。

(二)投资决策依据和投资程序 1、投资决策依据

(1)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;

(2)国内外宏观经济形势及对中国证券市场的影响: (3)国家货币政策,产业政策以及证券市场政策;

(6)股票、债券等类别资产的预期收益率及风险水平。

(4)行业发展现状及前景; (5)上市公司基本面及成长前导

人将投资和研究职能整合,设立了投资研究部,策略分析师、行业分析师、指数与量

环节,群策群力,为基金份额持有人谋取中、长期稳定的较高投资回报 3、投资决策程序

本基金具体的投资决策机制与流程为: (1)策略分析师就宏观、政策、投资主题、市场环境提交策略报告并讨论;行业 研究员就行业发展趋势和行业组合的估值比较,召开会议讨论确定行业评级;

(2)基金经理在策略会议的基础之上提出资产配置的建议; (3) 投资决策委员会审议基金经理提交的资产配置建议,并确定资产配置比

例的范围 (4)投资研究部提交股票库,在此基础上,基金经理、行业研究员决定核心股

票库名单 (5)基金经理在考虑资产配置的情况下,经过风险收益的权衡,决定投资组合

(6)投资总监审核投资组合方案后,交由基金经理实施; (7)集中交易室执行交易指令;

(8)稽核监察部进行全程风险评估和绩效分析。

九、基金的业绩比较基准 本基金业绩比较基准为

中证民营企业综合指数 × 80% + 上证国债指数 × 20% 选择该业绩基准,是基于以下因素:

1、中证民营企业综合指数和上证国债指数合理、透明; 2、中证民营企业综合指数和上证国债指数有较高的知名度和市场影响力;

3、中证民营企业综合指数由中证指数有限公司编制,成份股包括沪深两市全 部民营上市公司,可以全面反映沪深两市民营上市公司股票的整体表现;

4. 中证民营企业综合指数有一定市场覆盖案 不易被操纵: 5、基于本基金的投资范围和投资比例限制,选用该业绩比较基准能够忠实反 映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比

较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本

基金管理人在履行适当程序后,可以变更业绩比较基准并及时公告。 十、基金的风险收益特征 本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平低于股票型基金,高于债券型基

十一、基金的投资组合报告 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2020年03月

26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。 本报告期自2019年01月01日起至12月31日止。

金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金

《1 投资组合报告

1.1 期末基金资产组合情况

全额单位, 人民币元

金额单位:人民币元

序号	项目	金額	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,860,112,790.95	92.98
	其中:股票	3,860,112,790.95	92.98
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	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	238,209,737.51	5.74
8	其他各项资产	53,276,591.76	1.28
9	合计	4,151,599,120.22	100.00

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

民服务、修理和其他服

与基金资产净值比例 で、林、牧、渔业 息传输、软件和信 务业

注:本基金本报告期末未有港股通投资股票。

1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

5,396,3 三七互娱 恒生电子 135,249 448.8 治治食品 韦尔股份

鹏鼎控队

1.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

	10-0-1-1-4-3	10-07-01-07-0	990	(%)
1	300059	东方财富	339,926,470.15	10.31
2	300136	信维通信	275,204,739.98	8.35
3	603816	顾家家居	178,875,175.32	5.43
4	002475	立讯精密	167,390,221.36	5.08
5	002714	牧原股份	155,873,838.13	4.73
6	300033	同花順	154,536,367.91	4.69
7	002236	大华股份	151,699,448.16	4.60
8	601166	兴业银行	144,690,126.80	4.39
9	300003	乐普医疗	142,180,591.28	4.31
10	002371	北方华创	134,975,208.61	4.09
11	600276	恒瑞医药	134,418,485.30	4.08
12	600519	贵州茅台	133,976,699.63	4.06
13	603501	书尔股份	128,163,887.11	3.89
14	002555	三七互娱	119,660,024.50	3.63
15	000333	美的集团	116,613,790.25	3.54
16	002938	鹏鼎控股	110,462,599.51	3.35
17	603369	今世缘	104,247,310.58	3.16
18	601688	华泰证券	103,242,561.79	3.13
19	002557	治治食品	96,320,447.93	2.92
20	600529	山东药玻	93,994,143.69	2.85
21	002179	中航光电	92,490,490.60	2.81
22	002777	久远银海	92,228,833.15	2.80
23	600183	生益科技	91,447,510.56	2.77
24	002311	海大集团	90,845,748.22	2.76
25	600085	同仁堂	86,786,927.91	2.63
26	603039	泛微网络	84,949,063.95	2.58
27	600507	方大特钢	82,955,624.19	2.52
28	000063	中兴通讯	82,517,157.10	2.50
29	300770	新媒股份	82,405,160.81	2.50
30	300369	绿盟科技	78,381,419.37	2.38
31	002138	顺络电子	77,458,071.80	2.35
32	601233	桐昆股份	75,190,511.85	2.28
33	002685	华东重机	74,112,601.47	2.25
34	300122	智飞生物	72,600,670.42	2.20
35	002032	苏泊尔	71,961,518.40	2.18
36	000703	恒逸石化	71,441,223.15	2.17
37	002095	生意宝	68,363,389.05	2.07
38	600588	用友网络	67,997,244.10	2.06
39	300207	欣旺达	67,272,014.76	2.04
40	002142	宁波银行	66,721,911.12	2.02

注:本项"买入金额"按买入成交金额填列,不考虑相关交易费用。1.4.2 累计 卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

占期初基金资产净值比例(%

股票名称 本期累计卖出金额

牧原股份 143,736,234 109,231,779

86,820,968

1.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

信维通信

1.5 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。

1.6 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

1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.8 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贵金属投资

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

1.9 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。

1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未有投资股指期货

1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 注: 本基金本报告期内未投资国债期货

1.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调 查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机

构、证券交易所立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。 1.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。 1.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

1.12.4 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债券投资 1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

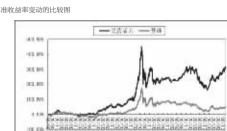
注:报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金则 产 但不保证其全一定盈利 也不保证品低收益 基金的过往业绩并不代表其未来 表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。 (一) 本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

十二. 基金的业绩

1.459

(二) 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起



1、基金管理人的管理费;

5、基金份额持有人大会费用;

(一)基金费用的种类

3.《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用: 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费

6. 基金的证券交易费用:

8. 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式 本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方

H=E×1.50%÷当年天数 H为每日应计提的基金管理费 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据基

金管理人的授权委托书,于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管 理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

方法如下:

2、基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算

H=E×0.25%÷当年天数 H为每日应计提的基金托管费

下列费用不列入基金费用:

E为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据基 金管理人的授权委托书,于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托

管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延 上述"(一)基金费用的种类"中第3-7项费用,根据有关法规及相应协议规 定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用; 3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按中国、海外销售地及投资

(一)根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《基金合同》、《托管协

目。 基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议; 调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会 基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在指定媒介站上公告。

人所在国家税收法律、法规执行。 十四、对招募说明书更新部分的说明

(二)针对"基金管理人"章节:更新了基金管理人的相关信息。 (三)针对"基金托管人"章节:更新了基金托管人的相关信息。

(五)针对"基金的业绩"章节:更新了基金的业绩。

注:本项"买入股票成本"和"卖出股票收入"均按买卖成交金额填列,不考虑

单位: 人民而元

(六)针对"其他应披露事项"章节:更新了本基金的相关公告。

议》的修订,更新《招募说明书》前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的收益与 分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容。

(四)针对"基金的投资"章节:更新了基金的投资组合报告。

汇添富基金管理股份有限公司