

汇添富睿丰混合型证券投资基金

2017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:中国银行股份有限公司
送出日期:2018年3月28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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月26日复核了本报告中的财务数据、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2017年9月29日（基金合同生效日）起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金名称	添富睿丰
基金代码	601039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月29日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	232,816,128.72份
基金合同存续期	不定期
基金上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016年11月12日
下属分级基金的基金简称	添富睿丰A类基金 添富睿丰C类基金
下属分级基金的基金简称	添富睿丰 添富睿丰C
下属分级基金的基金代码	501039 501040
报告期末下属分级基金的份额总额	227,607,293.56份 106,218,834.07份

注:本基金下属分级上市日期为:添富睿丰:2018年3月8日;添富睿C:2018年1月12日。

2.2 基金产品说明

投资目标	
本基金主要投资于债券等固定收益类资产，并通过投资股票等权益类资产增强收益，科学严格地管理风险的前提下，力争超越业绩比较基准的长期投资回报。	
投资策略	
本基金密切关注宏观经济运行情况，分析宏观经济形势对股票二级市场价格的影响，同时关注利率变化对债券价格的影响，以求通过大类资产配置，在此基础上，通过精选个股，把握市场机会，实现资产增值。	
业绩比较基准	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 本基金的风险水平低于股票型基金，属于中低风险基金。

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	中国银行股份有限公司
姓名	王景民	
联系电话	021-28932888	010-66948498
电子邮箱	service@99fund.com	icmb@icbc.com.cn
客户服务电话	400-888-9918	95566
传真	021-28932908	010-66949492

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址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市浦城路99号国都大厦12-23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	2017年9月29日(基金合同生效日)至2017年12月31日
添富睿丰混合A	添富睿丰混合C
本期已实现收益	333,170.18
5.49,446.35	45,366.62
5.49,446.35	2,428,044.06
5.49,446.35	0.0241
5.49,446.35	0.0231
5.49,446.35	2.41%
5.49,446.35	2.31%
5.49,446.35	2017年末
5.49,446.35	0.0005
5.49,446.35	0.0004
5.49,446.35	233,086,739.20
5.49,446.35	107,046,870.72
5.49,446.35	10241
5.49,446.35	10231

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(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之和减去部分的孰低数。

4.本基金的《基金合同》生效日为2017年9月29日,至本报告期未满一年,因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2017年12月31日数据,特此说明。

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

添富睿丰混合A

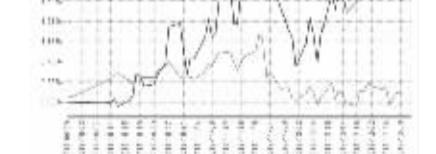
阶段	份额净值增长率(%)	份额净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	2.41%	0.38%	0.09%	0.16%	2.32%
自基金合同生效日起至今	2.41%	0.38%	0.19%	0.16%	2.22%

添富睿丰混合C

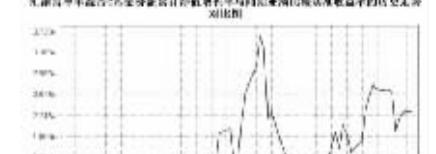
阶段	份额净值增长率(%)	份额净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去六个月	2.31%	0.38%	0.09%	0.16%	2.22%
自基金合同生效日起至今	2.31%	0.38%	0.19%	0.16%	2.22%

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

添富睿丰混合A



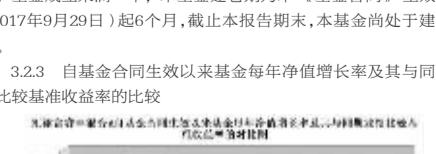
添富睿丰混合C



注:本《基金合同》生效之日为2017年9月29日,截至本报告期末,基金成立未满一年;本基金建仓期为《基金合同》生效之日起6个月,截至本报告期末,本基金尚未处于建仓期中。

3.2.3 自基金合同生效以来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

添富睿丰混合A



添富睿丰混合C



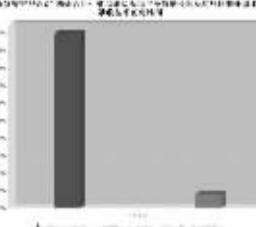
注:1.基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为公司决议确定的解聘日期;

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



注:1.本基金的《基金合同》生效日为2017年9月29日,至本报告期末未满1年。

2.合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金成立于2017年9月29日,2017年末进行利润分配。

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》，本公司制定了“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、监督稽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，公司建立了统一的研究平台信息管理系统，公司内部研究结果对所有基金经理和投资经理开放分享，同时通过投资研究员例会、投资研究交流会等研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。(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。各投资组合经理在授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。通过投资研究员例会、投资研究交流会等研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。(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控，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。(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，本公司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、交易决策、交易执行、业绩评估、监督稽查等相关部门组成，各部门共同履职，对投资交易的公平性、合规性、透明度和效率负责。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

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%、同向交易占比是否优劣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%、同向交易占比是否优劣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。

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%、同向交易占比是否优劣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。

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%、同向交易占比是否优劣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。

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%、同向交易占比是否优劣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。

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