

汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混 合型证券投资基金（LOF） 2018 年第 3 季度报告

2018 年 9 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 10 月 26 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 24 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 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	添富配售
场内简称	添富配售
交易代码	501188
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 7 月 5 日
报告期末基金份额总额	14,436,240,692.05 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要投资通过战略配售取得的股票，在封闭运作期内主要采用战略配售策略和债券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*60%+中债总指数收益率*40%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金以投资战略配售股票为主要投资策略，需参与并接受发行人战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。
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

§ 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（2018年7月5日—2018年9月30日）
1. 本期已实现收益	109,581,824.47
2. 本期利润	85,377,845.55
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0059
4. 期末基金资产净值	14,521,618,537.60
5. 期末基金份额净值	1.0059

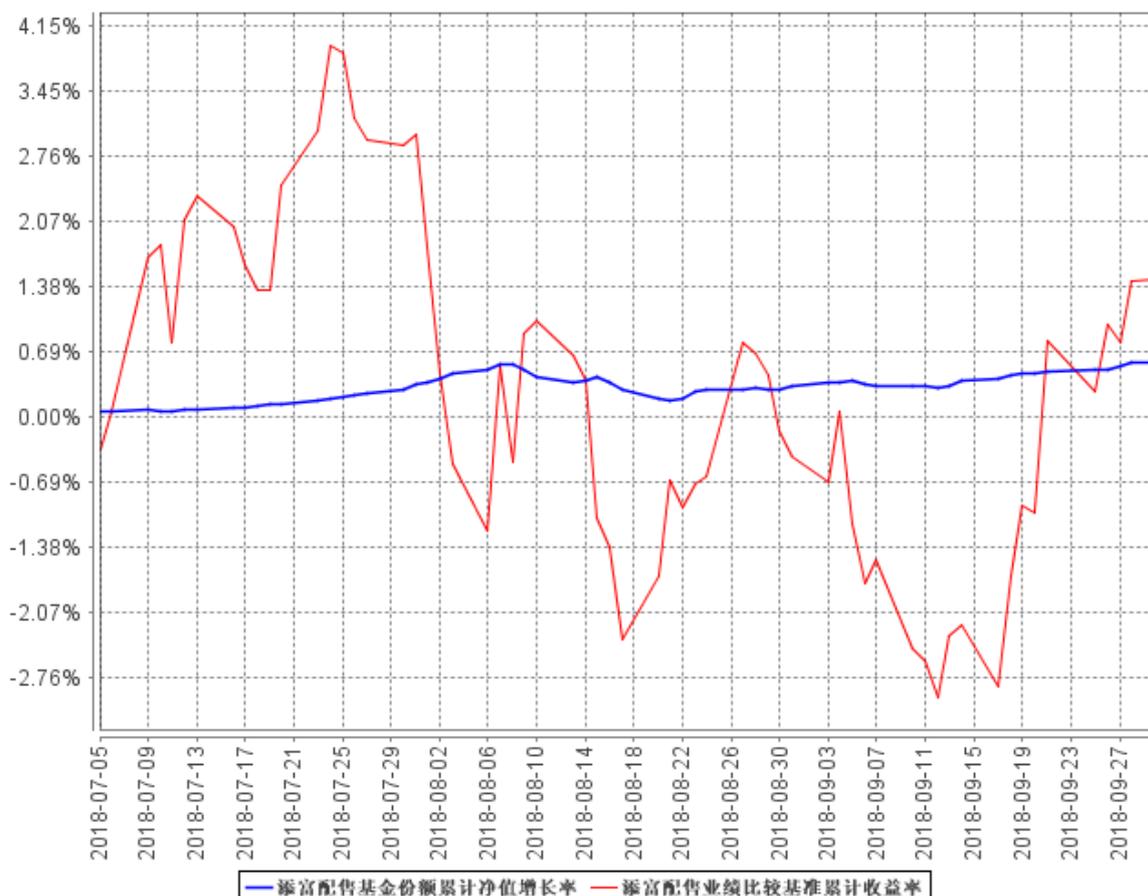
3.2 基金净值表现

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

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
自基金成立以来	0.59%	0.03%	1.47%	0.79%	-0.88%	-0.76%

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

添富配售基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2018 年 07 月 05 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 07 月 05 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		
刘伟林	汇添富新兴消费股票基金、	2018 年 7 月 5 日	-	10 年	国籍：中国。学历：北京大学经济学硕士。相关业务资格：

	添富配售基金的基金经理。				证券投资基金从业资格。从业经历：2008 年 7 月加入汇添富基金任行业分析师；2010 年 5 月至 2011 年 3 月在国家发展和改革委员会工作；2011 年 3 月至今在我司担任高级策略分析师。2015 年 12 月 2 日至今任汇添富新兴消费股票基金的基金经理，2018 年 7 月 5 日至今任添富配售基金的基金经理。
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、添富添福吉祥混合基金、添富盈润混合基金、汇添富弘安混合基金、添富配售基金的基金经理。	2018 年 7 月 5 日	-	20 年	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

					<p>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 29 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 日至今任添富配售基金的基金经理。</p>
杨璿	汇添富全球移动互联网混合基金、汇添	2018 年 7 月 5 日	-	8 年	<p>国籍：中国。学历：清华大学工程学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资</p>

	富文体娱乐混合基金、添富配售基金的基金经理				格。从业经历：2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司，2010年8月至2017年1月担任公司的TMT行业分析师，2017年1月25日至今任汇添富全球移动互联网混合基金的基金经理，2018年6月21日至今任汇添富文体娱乐混合基金的基金经理，2018年7月5日至今任添富配售基金的基金经理。
刘江	汇添富医疗服务混合基金、添富全球医疗混合(QDII)基金、添富配售基金、添富创新医药混合基金的基金经理。	2018年7月5日	-	7年	国籍：中国。学历：清华大学工学硕士，德国亚琛工大工学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011年5月加入汇添富基金管理股份有限公司任医药行业分析师，2015年6月18日至今任汇添富医疗服务混合基金的基金经理，2017年8月16日至今任添富全球医疗混合(QDII)基金的基金经理，2018年7月5日至今任添富配售基金的基金经理，2018年8月8日至今任添富创新医药混合基金的基金经理。

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合规守信情况的说明

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 3 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

2018 年 6 月起，CPI 逐月回升，8 月份达到 2.30%，为近年来除去 2018 年 2 月外的高点。去除了食品和能源价格之后的核心 CPI 也是逐月回升至 2.00%。虽然回升幅度不大，但是已经引起市场人士关注。PPI 的走势与 CPI 相反，在 6 月份达到今年以来的最高点 4.70%后开始回落，8 月份回到 4.10%。中国制造业采购经理指数 PMI 在 7 月稍有回落之后，基本平稳，其中的新订单

分项指数下降至 52.2。宏观基本面数据在今年第三季度涨跌互现。投资数据方面，固定资产投资和房地产投资的同比增速都在回落。制造业投资累计同比增速承接第二季度趋势，仍在反弹。从房地产的细项数据上看，70 个大中城市商品房价格指数在第三季度有明显回升，8 月份的同比涨幅达到 2017 年 8 月份的水平。销售额、销售面积和新开工面积的累计增速都有小幅反弹。货币政策方面，第三季度央行通过公开市场操作回笼货币 2400 亿元。M1 同比增速在第三季度仍然在下降，8 月份增速仅为 3.90%，创下历史新低。M2 同比增速仍然在低位徘徊，8 月份维持在 8.20% 水平。整个债券市场在第三季度呈现资金宽松的局面，只是在 9 月底短暂出现资金利率上升的情况。人民币兑美元汇率在第三季度继续贬值，至 9 月底基本回到 17 年 5 月的汇率水平。第三季度各月份的外汇占款增加额在 7 月份达到 108 亿元，是 2015 年 10 月以来的最高值，但是在 8 月份又出现负增长。

在第三季度，7 月份债券市场在资金面宽松的局面下收益率快速下降。进入 8 月份由于货币政策趋于中性，以及对后期通货膨胀上升的预期，市场利率出现上升。9 月份市场收益率震荡向下。中债综合财富指数上涨 1.48%。月度表现上，第三季度的 3 个月都获得正回报。股票市场第三季度沪深 300 指数下跌 2.05%。

本基金成立于 7 月上旬，在债券建仓策略上主要从 3 年运作的角度来考虑，品种上选择流动性好、信用安全性高的债券。重点配置交易所的公司债券和银行间的同业存单，少量配置利率债券以及中期票据。同时亦在积极寻找股票的战略配售机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0059 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.59%，业绩比较基准收益率为 1.47%。

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	13,571,355,715.00	93.35
	其中：债券	13,571,355,715.00	93.35
	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	720,000,000.00	4.95
	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	134,969,888.64	0.93
8	其他资产	112,533,918.39	0.77
9	合计	14,538,859,522.03	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：本基金本报告期末未持有股票投资。

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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末未持有股票投资。

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	328,734,000.00	2.26
	其中：政策性金融债	328,734,000.00	2.26
4	企业债券	5,440,497,715.00	37.46
5	企业短期融资券	1,191,519,000.00	8.21
6	中期票据	881,420,000.00	6.07
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	5,729,185,000.00	39.45
9	其他	-	-
10	合计	13,571,355,715.00	93.46

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（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111810373	18 兴业银行 CD373	4,000,000	386,040,000.00	2.66
2	111813116	18 浙商银行 CD116	3,300,000	317,988,000.00	2.19
3	071800029	18 中信 CP007BC	3,000,000	300,120,000.00	2.07
4	111881518	18 天津银行 CD212	3,000,000	295,080,000.00	2.03
5	111808222	18 中信银行 CD222	3,000,000	292,170,000.00	2.01

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：本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 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。

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	193,695.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	112,340,223.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	112,533,918.39

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有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：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年7月5日）基金份 额总额	14,436,240,692.05
基金合同生效日起至报告期期末基金总申 购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总 赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	14,436,240,692.05

注：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、中国证监会批准汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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

2018 年 10 月 26 日