

汇添富美丽 30 混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 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：2020 年 4 月 21 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 2020 年 04 月 17 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 2020 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 汇添富美丽 30 混合 |
| 基金主代码 | 000173 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 6 月 25 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,725,682,294.17 份 |
| 投资目标 | 本基金通过精选个股和集中投资，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。 |
| 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拥有优秀管理层、盈利能力高于行业平均水平、增长可持续且估值水平相对合理的优质上市公司，辅以严格的风险管理，以获得中长期的较高投资收益。投资策略的重点是个股精选策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×80%+证全债指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，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。 |
| 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（2020 年 1 月 1 日-2020 年 3 月 31 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 436,045,002.08 |
| 2. 本期利润 | -295,129,281.64 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1462 |
| 4. 期末基金资产净值 | 3,766,729,972.80 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.183 |

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。

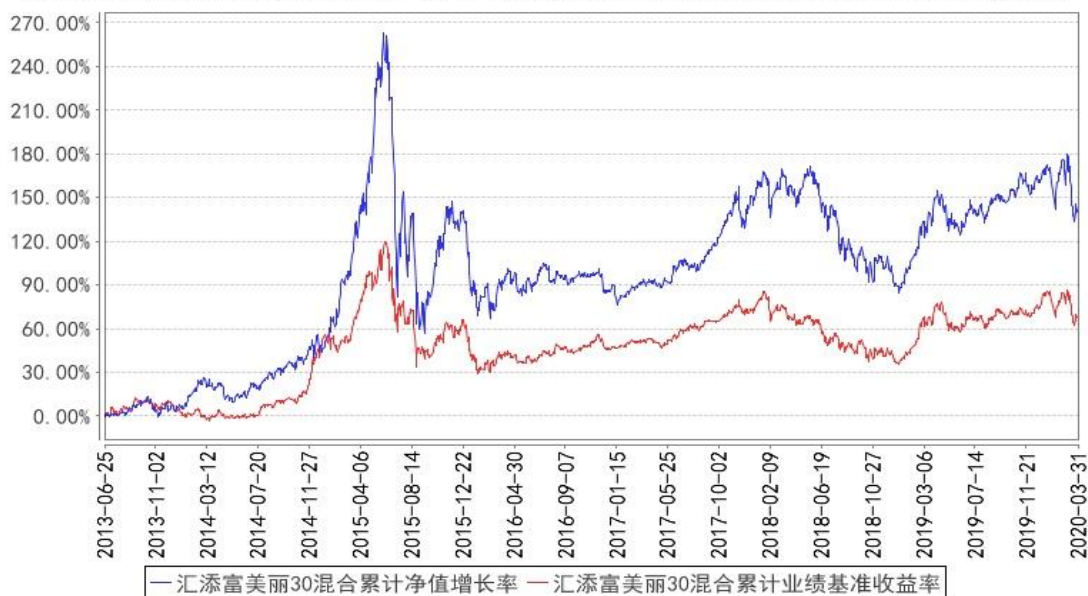
3.2 基金净值表现

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

| 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 | -7.73% | 2.05% | -7.39% | 1.55% | -0.34% | 0.50% |

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

汇添富美丽30混合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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013 年 6 月 25 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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 | | |
| 王栩 | 汇添富优势精选混合基金、汇添富美丽 30 混合基金、汇添富外延增长主题股票基金、汇添富大盘核心资产混合基金的基金经理，总经理助理、权益投资总监。 | 2013 年 6 月 25 日 | - | 18 年 | 国籍：中国。学历：同济大学管理学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任上海永嘉投资管理有限公司研究员。2004 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任总经理助理、权益投资总监。2010 年 2 月 5 日至今任汇添富优势精选混合基金的基金经理，2010 年 9 月 21 日至 2013 年 5 月 10 日任汇添富医药保健混合基金的基金经理，2012 年 7 月 10 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富理财 14 天债券基金的基金经理，2013 年 6 月 25 日至今任汇添富美丽 30 混合基金的基金经理，2019 年 1 月 18 日至今任汇添富外延增长主题股票基金的基金经理，2020 年 1 月 8 日至今任汇添富大盘核心资产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。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作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。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、

营运以及稽核监察等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

对于同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3 日内和 5 日内）同买或者同卖同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。根据 95%置信区间下平均价差率的 T 检验显著程度、同向交易占优比等方面进行综合分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。本报告期内，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司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成交量的 5%的情况有 8 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年一季度最重大的事件是新冠病毒疫情的爆发，全球的经济和金融市场都受到巨大的冲击。由于疫情首先在国内爆发，国内一季度的生产、投资、消费和国际贸易等经济活动都受到非常大的干扰，统计数据急剧下滑。政府也迅速出台了一系列应对措施。人民银行在新年开始就下调存款准备金率，为 2020 年的货币政策定下宽松的基调。疫情发生之后，人民银行继续通过定向降准、再贷款、再贴现以及 LPR 等工具引导金融机构支持实体经济。财政政策方面也比较积极，一季度财政部已经提前下达了 2020 年部分新增专项债券额度 12900 亿元，并允许地方政府适当提高用于符合条件的重大项目资本金的比例，通过促进投资来稳定经济增长。根据现有信息，政府在二季度之后还有可能通过特别国债和适当提高赤字率等方式来加大对经济的支持力度。至一季度末国内疫情已经基本得到有效控制，但由于全球多数国家的疫情还处于爆发期，投资者仍然需要面对非常不确定的经济环境。一季度末全球确诊病例已经接近 100 万人，全球金融市场进入极度恐慌状态，沙特与俄罗斯之间的原油价格战加剧了这种恐慌，美国部分金融机构出现流动性危机。尽管美联储通过两次降息将联邦基金利率降至 0%，并出台了无限制量化宽松政策，但美元依然紧缺，投资者阶段性处于“抛售一切”的状态，全球风险资产价格大幅下跌。全球主要发达国家的股票指数大都下跌超过 20%，原油价格下跌 67%，多数工业金属价格下跌超过 15%，仅黄金价

格小幅上涨。由于国内资本市场处于加大对外开放的进程之中，海外市场的动荡也冲击了国内市场，仅 3 月份沪股通和深股通的净流出资金额就达到 678 亿元。一季度沪深 300 指数下跌 10.02%，中小板指数下跌 1.94%，创业板指数上涨 4.10%。从结构上看，投资者偏好受宏观经济景气度影响小以及可能受益于经济刺激政策的资产，5G、新能源和自主科技创新等投资主题也阶段性受到追捧。分行业来看，农林牧渔、医药生物、计算机、通信、建筑材料等行业表现较好，逆势上涨；休闲服务、采掘、家用电器、非银金融等行业表现相对较差，跌幅超过 15%。

本基金在一季度根据产业和市场环境的变化对资产配置结构做出调整。期末股票资产比例为 81.3%，较年初下降 12.6 个百分点。行业配置方面，主要增持了农林牧渔、社会服务、TMT、商业贸易等行业，主要减持了家用电器、医药生物、房地产、公用事业和金融服务等行业。

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 2.183 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.73%，业绩比较基准收益率为-7.39%。

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 | 3,066,244,485.35 | 80.10 |
| | 其中：股票 | 3,066,244,485.35 | 80.10 |
| 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 | 758,699,751.71 | 19.82 |
| 8 | 其他资产 | 2,924,741.97 | 0.08 |
| 9 | 合计 | 3,827,868,979.03 | 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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

| | | | |
|---|------------------|------------------|-------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 122,210,000.00 | 3.24 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,353,488,570.20 | 35.93 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 90,131,147.31 | 2.39 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 197,843,743.91 | 5.25 |
| J | 金融业 | 357,896,399.75 | 9.50 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 245,436,371.20 | 6.52 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 147,516,252.98 | 3.92 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 342,490,000.00 | 9.09 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 209,232,000.00 | 5.55 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,066,244,485.35 | 81.40 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1 | 002044 | 美年健康 | 29,000,000 | 342,490,000.00 | 9.09 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 210,000 | 233,310,000.00 | 6.19 |
| 3 | 002127 | 南极电商 | 20,000,000 | 232,000,000.00 | 6.16 |
| 4 | 000001 | 平安银行 | 17,000,000 | 217,600,000.00 | 5.78 |
| 5 | 300413 | 芒果超媒 | 4,800,000 | 209,232,000.00 | 5.55 |
| 6 | 000786 | 北新建材 | 7,699,928 | 181,718,300.80 | 4.82 |
| 7 | 603259 | 药明康德 | 1,630,000 | 147,498,700.00 | 3.92 |
| 8 | 002142 | 宁波银行 | 6,000,000 | 138,360,000.00 | 3.67 |
| 9 | 300010 | 立思辰 | 8,599,905 | 132,610,535.10 | 3.52 |
| 10 | 002714 | 牧原股份 | 1,000,000 | 122,210,000.00 | 3.24 |

5.4 报告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。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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：本基金本报告期末无股指期货持仓。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末无国债期货持仓。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,150,092.31 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 137,489.06 |
| 5 | 应收申购款 | 1,637,160.60 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,924,741.97 |

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不存在流通受限的情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,511,282,755.49 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 175,719,914.79 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 961,320,376.11 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,725,682,294.17 |

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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|--------------------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 4,709,844.56 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 4,709,844.56 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.27 |

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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美丽 30 股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富美丽 30 混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富美丽 30 混合型证券投资基金托管协议》；

- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富美丽 30 混合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

2020 年 4 月 21 日