

# 汇添富添福吉祥混合型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告

2017 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：2017 年 10 月 25 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 2017 年 10 月 23 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 2017 年 7 月 24 日（基金合同生效日）起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	添富添福吉祥混合
交易代码	004774
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 7 月 24 日
报告期末基金份额总额	1,560,981,479.63 份
投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，适度投资权益类品种以增强收益，在科学严格管理风险的前提下，力争实现稳定的绝对回报，为投资者提供稳健收益的理财工具。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略，通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益，并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报，在灵活配置各类资产以及严格的风险管理基础上，力争实现基金资产的持续稳定增值。
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	本基金为债券投资为主的混合型基金，属于中低风险、中低收益预期的基金品种，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。
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( 2017 年 7 月 24 日 — 2017 年 9 月 30 日 )
1. 本期已实现收益	7,435,519.94
2. 本期利润	27,509,529.77
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0171
4. 期末基金资产净值	1,587,838,572.78
5. 期末基金份额净值	1.0172

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。

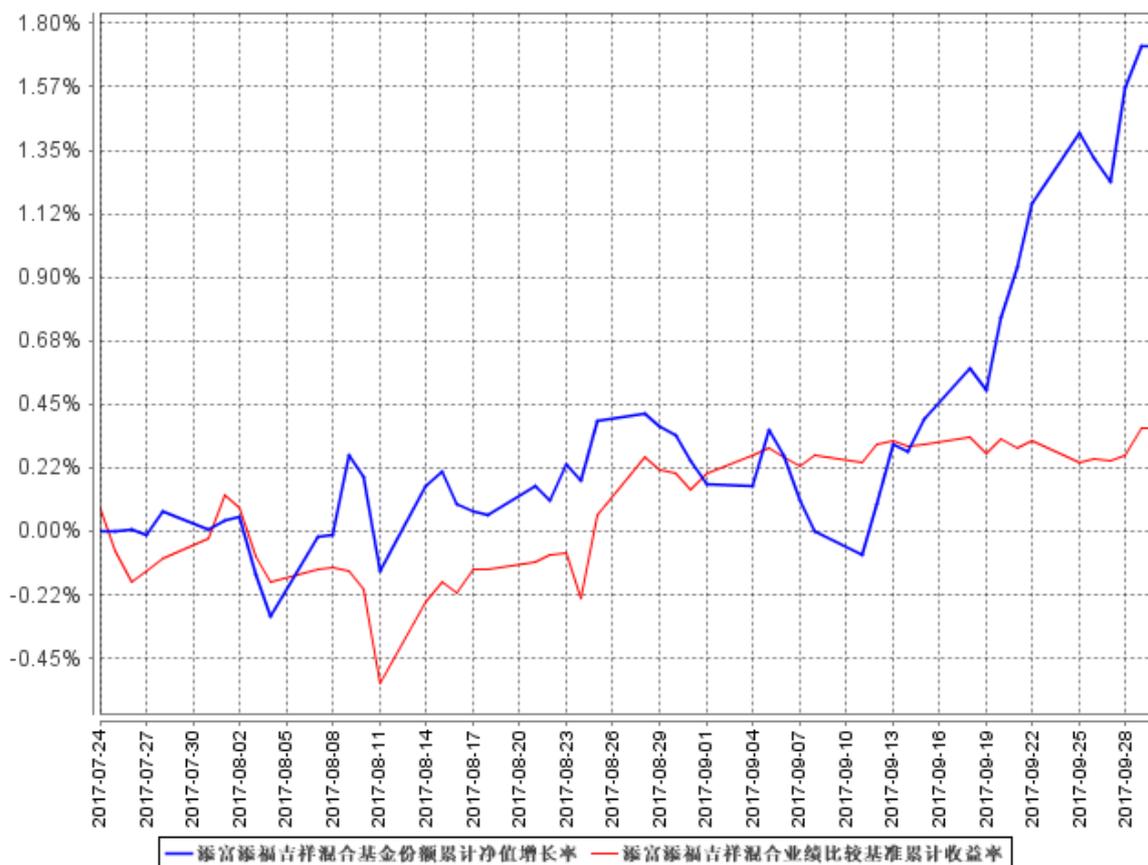
#### 3.2 基金净值表现

##### 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
自基金合同 生效日起至 今	1.72%	0.15%	0.37%	0.10%	1.35%	0.05%

### 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

添富添福吉祥混合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 2017 年 7 月 24 日，截至本报告期末，基金成立未满 1 年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017 年 7 月 24 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		
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	2017 年 7 月 24 日	-	19 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

	<p>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的基金经理。</p>			<p>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 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</p>
--	--	--	--	--

					(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。
胡昕炜	汇添富消费行业混合基金、添富添福吉祥混合基金、添富盈润混合基金的基金经理。	2017年7月28日	-	6年	国籍：中国。学历：清华大学工学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011年加入汇添富基金任行业分析师。2016年4月8日至今任汇添富消费行业混合基金的基金经理, 2017年7月28日至今任添富添福吉祥混合基金的基金经理, 2017年9月20日至今任添富盈润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未出现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%的情况，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

2017 年 6 至 8 月份，CPI 较第二季度小幅抬升，分别同比上涨 1.5%、1.4%和 1.8%。去除食品和能源价格之后，核心 CPI 仍然比较稳定，一直在 2.1%上下。PPI 在过去的三个月里，受到大宗商品价格的影响，同比涨幅略有反弹，6 月、7 月和 5 月份持平，在 8 月份回升至 6.30%。采购经理人指数 PMI 在第三季度有所反弹，皆高于 6 月份的数字。宏观基本面的数据在第三季度有所走弱。固定资产投资方面，基础设施建设投资和房地产投资在 6 月份有所反弹，之后两个月不断走低。从房地产的细项数据上看，6 月份开始，70 个大中城市商品房价格指数持续下滑，销售面积增速累计同比数据除 6 月份反弹以外，7-8 月份都有所下降，销售额和新开工面积的累计同比也呈现相同趋势。货币政策方面，央行并未释放宽松信号。在第三季度，央行向市场投放资金的规模较第二季度有所下降。央行通常使用短期公开市场工具来管理金融市场流动性。在第三季度

末，央行推出定向降准的政策，计划在 2018 年 1 月开始正式实施。人民币兑美元汇率在第三季度前两个月持续升值，只是在 9 月份出现回落。在此背景下，外汇占款负增长的幅度逐步减小，显示外汇有逐步回流的趋势。

第三季度，债券市场指数略有上升，中债综合财富指数上涨 0.79%，涨幅较第二季度有所扩大。债券指数整个三季度涨幅平缓，其中 9 月份涨幅最大，指数每逢月末由于资金面原因而略有回调。股票市场上，沪深 300 指数在第三季度上涨 4.63%。7 月份市场平稳上涨，8 月初略有回调之后反弹较为快速，9 月份基本维持一个窄幅震荡的格局。

本基金在 7 月 24 日成立。第三季度属于本基金的建仓阶段。主要方向上是买入交易所的公司债券以及银行间的中票。另外，根据股票市场的热点，以及我们公司对于个股基本面的深入研究，买入成长良好、业绩持续稳定的个股。

#### 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 1.0172 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.72%，业绩比较基准收益率为 0.37%。

#### 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	397,309,204.80	24.91
	其中：股票	397,309,204.80	24.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,038,952,742.30	65.15
	其中：债券	1,038,952,742.30	65.15
	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	110,000,000.00	6.90
	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	32,495,659.81	2.04

8	其他资产	16,024,756.15	1.00
9	合计	1,594,782,363.06	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	304,961,046.88	19.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,795,424.00	0.68
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	81,552,733.92	5.14
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	397,309,204.80	25.02

### 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投资股票。

## 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	000651	格力电器	2,050,048	77,696,819.20	4.89
2	600887	伊利股份	2,200,045	60,501,237.50	3.81
3	601939	建设银行	8,041,353	56,048,230.41	3.53
4	600519	贵州茅台	99,700	51,608,708.00	3.25

5	002304	洋河股份	390,600	39,645,900.00	2.50
6	000910	大亚圣象	1,249,512	26,089,810.56	1.64
7	601336	新华保险	450,053	25,504,503.51	1.61
8	600779	水井坊	469,311	19,626,586.02	1.24
9	600872	中炬高新	719,200	16,994,696.00	1.07
10	600867	通化东宝	663,072	12,797,289.60	0.81

#### 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	10,706,660.00	0.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,998,000.00	7.56
	其中：政策性金融债	119,998,000.00	7.56
4	企业债券	580,191,582.30	36.54
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	120,554,000.00	7.59
7	可转债（可交换债）	31,462,500.00	1.98
8	同业存单	176,040,000.00	11.09
9	其他	-	-
10	合计	1,038,952,742.30	65.43

#### 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	111711402	17 平安银行 CD402	1,000,000	97,800,000.00	6.16
2	111715324	17 民生银行 CD324	800,000	78,240,000.00	4.93
3	170207	17 国开 07	700,000	69,783,000.00	4.39
4	112384	16 歌尔 01	570,000	56,355,900.00	3.55
5	170215	17 国开 15	500,000	50,215,000.00	3.16

#### 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

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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：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、处罚的情形。

### 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	105,708.71
2	应收证券清算款	6,978,786.80
3	应收股利	-
4	应收利息	8,768,319.16
5	应收申购款	171,941.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,024,756.15

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	132005	15 国资 EB	1,992,600.00	0.13

**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

基金合同生效日（2017年7月24日）基金份 额总额	1,607,830,629.70
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份 额	1,507,937.01
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎 回份额	48,357,087.08
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	1,560,981,479.63

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添福吉祥混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富添福吉祥混合型证券投资基金合同》；
- 3、《汇添富添福吉祥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、报告期内汇添富添福吉祥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 21 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](http://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

2017 年 10 月 25 日