

嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券 投资基金 2019 年第 1 季度报告

2019 年 3 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 4 月 20 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实新添康定期混合	
基金主代码	005603	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 9 月 27 日	
报告期末基金份额总额	213,181,446.00 份	
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四个角度进行综合分析，在控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50% +中债综合财富指数收益率×50%。	
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实新添康定期混合 A	嘉实新添康定期混合 C
下属分级基金的交易代码	005603	005604
报告期末下属分级基金的份额总额	207,223,506.37 份	5,957,939.63 份

§ 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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
	嘉实新添康定期混合 A	嘉实新添康定期混合 C
1. 本期已实现收益	2,140,618.06	52,398.69
2. 本期利润	4,412,850.03	117,622.63
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0213	0.0197
4. 期末基金资产净值	213,404,881.37	6,117,034.09
5. 期末基金份额净值	1.0298	1.0267

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）嘉实新添康定期混合 A 收取认（申）购费用和赎回费，嘉实新添康定期混合 C 从本类基金资产中计提销售服务费，不收取认（申）购费用但收取赎回费；（3）上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

嘉实新添康定期混合 A

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	2.11%	0.14%	14.28%	0.77%	-12.17%	-0.63%

嘉实新添康定期混合 C

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	1.96%	0.14%	14.28%	0.77%	-12.32%	-0.63%

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率变动的比较

嘉实新添康定期混合 A 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



图 1：嘉实新添康定期混合 A 基金累计份额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

(2018 年 9 月 27 日至 2019 年 3 月 31 日)

嘉实新添康定期混合 C 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



图 2：嘉实新添康定期混合 C 基金累计份额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

(2018 年 9 月 27 日至 2019 年 3 月 31 日)

注：本基金基金合同生效日 2018 年 9 月 27 日至报告期末未满 1 年。按基金合同和招募说明书的第 4 页 共 12 页

约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

§ 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		
刘宁	本基金、嘉实增强信用定期债券、嘉实如意宝定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实稳荣债券、嘉实新添瑞混合、嘉实新添华定期混合、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实润泽量化定期混合、嘉实润和量化定期混合、嘉实新添荣定期混合、嘉实战略配售混合、嘉实致盈债券基金经理	2018 年 9 月 27 日	-	14 年	经济学硕士，2004 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，在公司多个业务部门工作，2005 年开始从事投资相关工作，曾任债券专职交易员、年金组合组合控制员、投资经理助理、机构投资部投资经理。

注：（1）基金经理的任职日期是指本基金基金合同生效之日；（2）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 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、

严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，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，合计 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内国内外宏观经济平稳运行，流动性保持宽松，中美关系在一季度出现了阶段性缓和，市场对实体经济预期边际改善，资本市场风险偏好回升。

基本面角度，尽管经济生产端与需求端还未在数据上表现出明显触底现象，地产整体仍在下行，但政策逆周期调节更加具体，体现在一二线城市地产销量回升，活跃度明显改善，地产投资增速好于市场预期；消费虽仍在下滑，但减税降费可能使消费早于 GDP 见底；地方债提前发行，基建投资加码程度有所抬升。通胀方面，猪瘟疫情不断发酵，2 月下旬开始生猪价格大幅反弹，春节提前使得工业品价格整体较去年水平抬升，国际油价有所反弹，通胀中枢较去年年末预期有所抬升。流动性方面，一季度实体经济和金融体系流动性都较为宽松，1 月信贷社融大幅改善，尽管 2-3 月略有收缩，但总体带动融资水平边际企稳，M1、M2 也都呈现阶段性稳定。1-2 月外资大幅流入国内金融市场，银行间利率整体宽松，金融市场流动性改善。

债券市场在流动性宽松、实体融资环境改善的情况下，中短期品种收益率明显下行，1-3 年利率债下行 15-20bp，1-3 年信用债下行 20-40bp，特别是中短久期低等级品种。长端品种收益率在基本面预期改善的情况下小幅下行，利率曲线陡峭化。

权益市场一季度股票市场风险偏好出现显著回升，市场显著上涨，万得全 A 涨幅超过 30%。A 股各指数和版块呈现普涨态势。投资者对资产弹性的重视程度显著大于盈利和估值，使得科技主题和成长风格成为市场热点，成长风格大幅度跑赢了价值风格，中小板、创业板的涨幅显著高于大盘蓝筹板块。

报告期内本基金继续本着稳健投资原则，在风险和收益之间进行平衡。中高等级信用债持仓为主获取稳定收益，并积极参与利率债交易，提升组合业绩。提升股票仓位，分享权益市场带来的收益，积极参与股票 IPO 及可转债一级市场申购提升收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实新添康定期混合 A 基金份额净值为 1.0298 元，本报告期基金份额净值增

长率为 2.11%；截至本报告期末嘉实新添康定期混合 C 基金份额净值为 1.0267 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.96%；业绩比较基准收益率为 14.28%。

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	24,200,808.29	7.72
	其中：股票	24,200,808.29	7.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	277,432,815.30	88.51
	其中：债券	277,432,815.30	88.51
	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	3,808,552.26	1.22
8	其他资产	8,009,630.18	2.56
9	合计	313,451,806.03	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	17,294,718.29	7.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,255,760.00	1.03
E	建筑业	-	-
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	2,360,952.00	1.08
J	金融业	2,289,378.00	1.04
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	24,200,808.29	11.02

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	600535	天士力	231,100	5,204,372.00	2.37
2	600104	上汽集团	161,800	4,218,126.00	1.92
3	600276	恒瑞医药	48,000	3,140,160.00	1.43
4	002025	航天电器	89,459	2,481,592.66	1.13
5	002410	广联达	79,200	2,360,952.00	1.08
6	601229	上海银行	191,100	2,289,378.00	1.04
7	600483	福能股份	234,000	2,255,760.00	1.03
8	000895	双汇发展	85,000	2,197,250.00	1.00
9	603379	三美股份	1,641	53,217.63	0.02

注：报告期末，本基金仅持有上述 9 只股票。

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	2,166,379.20	0.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,984,000.00	6.83
	其中：政策性金融债	5,117,000.00	2.33
4	企业债券	71,273,788.90	32.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	91,368,000.00	41.62
7	可转债（可交换债）	583,647.20	0.27
8	同业存单	97,057,000.00	44.21
9	其他	-	-
10	合计	277,432,815.30	126.38

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	111814245	18 江苏银行 CD245	300,000	29,286,000.00	13.34
2	111882133	18 南京银行 CD100	300,000	29,070,000.00	13.24
3	111883113	18 宁波银行 CD154	300,000	29,016,000.00	13.22
4	101761006	17 首钢 MTN002	100,000	10,408,000.00	4.74
5	1382121	13 神华 MTN1	100,000	10,389,000.00	4.73

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

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

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

报告期末，本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注**5.11.1 声明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。**

(1) 2018年10月8日,中国银行业监督管理委员会上海监管局发布行政处罚信息公开表(沪银监罚决字〔2018〕49号),对上海银行股份有限公司2015年5月至2016年5月违规向其关系人发放信用贷款等违规事实,于2018年10月8日作出行政处罚决定,责令改正并罚没合计1,091,460.03元。2018年10月18日,中国银行业监督管理委员会上海监管局发布行政处罚信息公开表(沪银监罚决字〔2018〕54号),对上海银行股份有限公司2017年对某同业资金违规投向

资本金不足的房地产项目合规性审查未尽职等违规事实,于 2018 年 10 月 18 日作出行政处罚决定,责令改正并处罚款 50 万元。

本基金投资于“上海银行(601229)”的决策程序说明:基于上海银行基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于“上海银行”股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中,其他九名证券发行主体无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。

5.11.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	25,970.72
2	应收证券清算款	3,441,754.50
3	应收股利	-
4	应收利息	4,541,904.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,009,630.18

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603379	三美股份	53,217.63	0.02	未上市

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实新添康定期混合 A	嘉实新添康定期混合 C
报告期期初基金份额总额	207,223,506.37	5,957,939.63
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	207, 223, 506. 37	5, 957, 939. 63
-------------	-------------------	-----------------

§ 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

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2019 年 4 月 20 日

