

# 汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告

2019 年 6 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 7 月 17 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 7 月 15 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。

汇添富盈安保本混合型证券投资基金于 2019 年 04 月 27 日变更注册为汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金。基金托管人及基金注册登记机构不变，基金代码亦保持不变。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。其中，2019 年 4 月 27 日起，“汇添富盈安保本混合型证券投资基金”转型为“汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金”。汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金基金合同及托管协议即日生效。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	汇添富盈安混合
基金主代码	002419
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 4 月 27 日
报告期末基金份额总额	323,161,313.09 份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过积极主动的资产配置，充分挖掘各大类资产投资机会，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素（其中，基本面因素包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、固定资产投资总量、发电量等宏观经济统计数据；政策面因素包括存款准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等

	货币政策、政府购买总量、转移支付水平以及税收政策等财政政策；市场面因素包括市场参与者情绪、市场资金供求变化、市场 P/E 与历史平均水平的偏离程度等），结合全球宏观经济形势，研判国内外经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，对投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种进行战略配置和动态调整，以规避或分散市场风险，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

## 2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	汇添富盈安保本
基金主代码	002419
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 19 日
报告期末基金份额总额	401,883,143.31 份
投资目标	本基金主要通过投资组合保险技术来运作，在保证本金安全的前提下，力争在保本期内实现基金财产的稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，利用组合保险技术，动态调整安全资产与风险资产的投资比例，以确保基金在保本周期到期时，实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。安全资产主要包括国债、央行票据、银行存款等品种。风险资产主要包括股票、权证、股指期货等品种。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金保证人	深圳市高新投集团有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019 年 4 月 27 日 - 2019 年 6 月 30 日)
1. 本期已实现收益	4,151,545.43
2. 本期利润	11,941,248.32
3. 加权平均基金份额本期	0.0344

利润	
4. 期末基金资产净值	365,145,279.86
5. 期末基金份额净值	1.130

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、汇添富盈安保本混合型证券投资基金于 2019 年 04 月 27 日起正式转型为汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金。

### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019 年 4 月 1 日 - 2019 年 4 月 26 日)
1. 本期已实现收益	15,564,563.68
2. 本期利润	4,615,652.36
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0069
4. 期末基金资产净值	439,183,588.69
5. 期末基金份额净值	1.093

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（转型后）

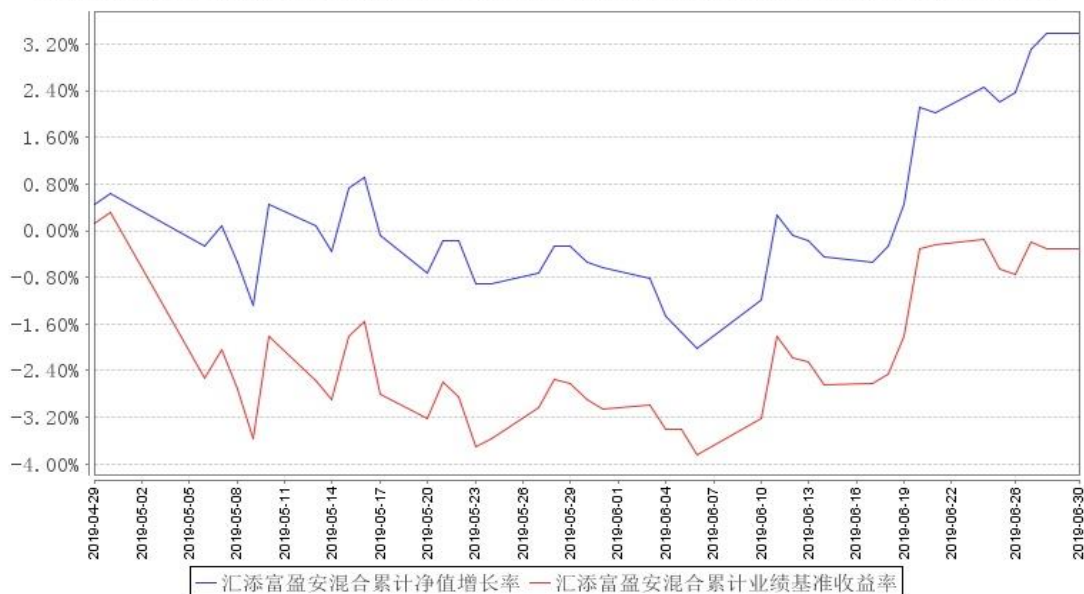
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 (2019 年 4 月 27 日至 2019 年 6 月 30 日)	3.39%	0.64%	-0.30%	0.78%	3.69%	-0.14%

注：本基金的《基金合同》生效日为 2019 年 4 月 27 日，至本报告期未满一年。

### 3.2.2 自基金转型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

汇添富盈安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：1、本基金的《基金合同》生效日为 2019 年 4 月 27 日，截止本报告期末，基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2019 年 4 月 27 日）起 6 个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 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 (2019 年 4 月 1 日至 2019 年 4 月 26 日)	0.18%	0.25%	0.20%	0.01%	-0.02%	0.24%

#### 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

汇添富盈安保本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（2016 年 4 月 19 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
曾刚	汇添富多元收益、可转换债券、实业债债券、双利增强债券、汇添富安鑫智选混合、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富 6 月红定期开放债券基金、汇添富盈安混合（原汇添富盈安保本混合）基金、	2016 年 4 月 19 日	-	18 年	国籍：中国。 学历：中国科技大学学士，清华大学 MBA。 业务资格：基金从业资格。 从业经历： 2008 年 5 月 15 日至 2010 年 2 月 5 日任华富货币基金的基金经理、2008 年 5 月 28 日至 2011 年 11 月 1 日任华富收益增强基金的基金经理、2010 年 9 月 8 日至

	<p>汇添富盈稳保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富长添利定期开放债券基金、添富年年益定开混合基金、添富熙和混合基金、汇添富达欣混合基金的基金经理，现金管理部总经理。</p>			<p>2011 年 11 月 1 日任华富强化回报基金的基金经理。2011 年 11 月加入汇添富基金，现任固定收益投资副总监。2012 年 5 月 9 日至 2014 年 1 月 21 日任汇添富理财 30 天基金的基金经理，2012 年 6 月 12 日至 2014 年 1 月 21 日任汇添富理财 60 天基金的基金经理，2012 年 9 月 18 日至今任汇添富多元收益基金的基金经理，2012 年 10 月 18 日至 2014 年 9 月 17 日任汇添富理财 28 天基金的基金经理，2013 年 1 月 24 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富理财 21 天基金的基金经理，2013 年 2 月 7 日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理，2013 年 5 月 29 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富理财 7 天基金的基金经理，2013 年 6</p>
--	---	--	--	--

				<p>月 14 日至今任汇添富实业债基金的基金经理，2013 年 9 月 12 至 2015 年 3 月 31 日任汇添富现金宝货币基金的基金经理，2013 年 12 月 3 日至今任汇添富双利增强债券基金的基金经理，2015 年 11 月 26 日至今任汇添富安鑫智选混合基金的基金经理，2016 年 2 月 17 日至今任汇添富 6 月红定期开放债券基金的基金经理，2016 年 3 月 16 日至今任汇添富稳健添利定期开放债券基金的基金经理，2016 年 4 月 19 日至今任汇添富盈安混合（原汇添富盈安保本混合）基金的基金经理，2016 年 8 月 3 日至今任汇添富盈稳保本混合基金的基金经理，2016 年 9 月 29 日至今任汇添富保鑫保本混合基金的基金经理，2016 年 12 月 6</p>
--	--	--	--	---



					<p>日至今任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理，2017年5月15日至今任添富年年益定开混合的基金经理，2018年2月11日至今任添富熙和混合基金的基金经理，2018年7月6日至今任汇添富达欣混合基金的基金经理。</p>
吴江宏	<p>汇添富可转换债券基金、汇添富盈安混合（原汇添富盈安保本混合）基金、汇添富盈稳保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富鑫利定开债、汇添富绝对收益定开混合、汇添富鑫益定开债、添富鑫汇定开债券基金、汇添富民丰回报混合、添富鑫永定开债、添富鑫盛定开债、添富年年丰定开混合、汇添富</p>	2016年4月19日	-	8年	<p>国籍：中国，学历：厦门大学经济学硕士。2011年加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益分析师。2015年7月17日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理，2016年4月19日至今任汇添富盈安混合（原汇添富盈安保本混合）基金的基金经理，2016年8月3日至今任汇添富盈稳保本混合基金的基金经理，2016年9月29日至今任汇添富保鑫保本混合基金的基金经理，</p>

	<p>双利债券的基金经理。</p>			<p>2017年3月13日至今任汇添富鑫利定开债基金（原添富鑫利债券基金）的基金经理，2017年3月15日至今任汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理，2017年4月20日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理，2017年6月23日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理，2017年9月27日至今任汇添富民丰回报混合基金的基金经理，2018年1月25日至今任添富鑫永定开债基金的基金经理，2018年4月16日至今任添富鑫盛定开债基金的基金经理，2018年9月28日至今任添富年年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。</p>
--	-------------------	--	--	---

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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		
曾刚	汇添富多元	2016年4月19日	-	18年	国籍：中国。

	<p>收益、可转换债券、实业债债券、双利增强债券、汇添富安鑫智选混合、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富 6 月红定期开放债券基金、汇添富盈安保本混合基金、汇添富盈稳保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富长添利定期开放债券基金、添富年年益定开混合基金、添富熙和混合基金、汇添富达欣混合基金的基金经理，现金管理部总经理。</p>			<p>学历：中国科技大学学士，清华大学 MBA。          业务资格：基金从业资格。          从业经历：          2008 年 5 月 15 日至 2010 年 2 月 5 日任华富货币基金的基金经理、2008 年 5 月 28 日至 2011 年 11 月 1 日任华富收益增强基金的基金经理、2010 年 9 月 8 日至 2011 年 11 月 1 日任华富强化回报基金的基金经理。2011 年 11 月加入汇添富基金，现任固定收益投资副总监。          2012 年 5 月 9 日至 2014 年 1 月 21 日任汇添富理财 30 天基金的基金经理，2012 年 6 月 12 日至 2014 年 1 月 21 日任汇添富理财 60 天基金的基金经理，2012 年 9 月 18 日至今任汇添富多元收益基金的基金经理，2012 年 10 月 18 日至 2014 年 9 月 17 日任汇添富理财 28 天基金</p>
--	--	--	--	---

				<p>的基金经理，2013 年 1 月 24 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富理财 21 天基金的基金经理，2013 年 2 月 7 日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理，2013 年 5 月 29 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富理财 7 天基金的基金经理，2013 年 6 月 14 日至今任汇添富实业债基金的基金经理，2013 年 9 月 12 至 2015 年 3 月 31 日任汇添富现金宝货币基金的基金经理，2013 年 12 月 3 日至今任汇添富双利增强债券基金的基金经理，2015 年 11 月 26 日至今任汇添富安鑫智选混合基金的基金经理，2016 年 2 月 17 日至今任汇添富 6 月红定期开放债券基金的基金经理，2016 年 3 月 16 日至今任汇添富稳健添利定期开放债券基金的基金经</p>
--	--	--	--	---

					理，2016 年 4 月 19 日至今任汇添富盈安保本混合基金的基金经理，2016 年 8 月 3 日至今任汇添富盈稳保本混合基金的基金经理，2016 年 9 月 29 日至今任汇添富保鑫保本混合基金的基金经理，2016 年 12 月 6 日至今任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理，2017 年 5 月 15 日至今任添富年年益定开混合的基金经理，2018 年 2 月 11 日至今任添富熙和混合基金的基金经理，2018 年 7 月 6 日至今任汇添富达欣混合基金的基金经理。
吴江宏	汇添富可转换债券基金、汇添富盈安保本混合基金、汇添富盈稳保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富鑫利定开债、汇添富绝对收益	2016 年 4 月 19 日	-	8 年	国籍：中国，学历：厦门大学经济学硕士。2011 年加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益分析师。2015 年 7 月 17 日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理，2016 年 4

	<p>定开混合、汇添富鑫益定开债、添富鑫汇定开债券基金、汇添富民丰回报混合、添富鑫永定开债、添富鑫盛定开债、添富年年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。</p>			<p>月 19 日至今任汇添富盈安保本混合基金的基金经理，2016 年 8 月 3 日至今任汇添富盈稳保本混合基金的基金经理，2016 年 9 月 29 日至今任汇添富保鑫保本混合基金的基金经理，2017 年 3 月 13 日至今任汇添富鑫利定开债基金（原添富鑫利债券基金）的基金经理，2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理，2017 年 4 月 20 日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理，2017 年 6 月 23 日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理，2017 年 9 月 27 日至今任汇添富民丰回报混合基金的基金经理，2018 年 1 月 25 日至今任添富鑫永定开债基金的基金经理，2018 年 4 月 16 日至今任添富鑫盛定</p>
--	---	--	--	---

					开债基金的基金经理，2018 年 9 月 28 日至今任添富年年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

二季度经济供需双弱，工业增加值持续走低，固定资产投资增速持续回落。一季度社融总量投放，二季度社融投放总量有所回落，但仍然偏积极。政策面，政策相机抉择的特征表现明显。3 月经济数据超预期，政策结束前期的危机模式，强化中长期的改革开放和结构性调整。4、5 月经济下行压力显现，贸易战出现反复，逆周期调节政策逐步出台。

二季度，债券收益率先上后下。1 年国开上行 20BP 至 2.73%，10 年国债持平在 3.6%。信用债跟随利率债走势以上行为主，不过信用利差有所压缩。二季度中债总财富指数上涨 0.38%。

相比一季度的普涨，二季度股票市场出现明显分化，上证 50 指数上涨 3.2%，沪深 300 指数下跌 1.2%，中证 500 指数下跌 10.8%。基本面持续性和稳定性较强的核心资产再次受到市场的追捧，以食品饮料为代表的行业有明显超额收益。可转债压估值现象明显，转债指数下跌 3.6%。

保本期结束后组合转型为偏债混合基金，组合大幅增加权益资产配置，持仓以基本面稳定性较强的行业龙头为主，行业相对分散。债券投资配置为主，久期中性偏短，不暴露信用风险。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

自 2019 年 4 月 27 日本基金转型成立后，截至本报告期末本基金份额净值为 1.130 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.39%，业绩比较基准收益率为-0.30%。

### 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（转型后）

### 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	129,645,136.00	29.67
	其中：股票	129,645,136.00	29.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	295,210,996.04	67.57
	其中：债券	295,210,996.04	67.57
	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	6,788,370.28	1.55
8	其他资产	5,240,636.59	1.20
9	合计	436,885,138.91	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	62,699,076.00	17.17
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	15,658,000.00	4.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,657,850.00	0.73
J	金融业	33,088,500.00	9.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,113,000.00	3.04
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	4,428,710.00	1.21
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	129,645,136.00	35.51

### 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	601318	中国平安	200,000	17,722,000.00	4.85
2	600036	招商银行	300,000	10,794,000.00	2.96
3	601888	中国国旅	100,000	8,865,000.00	2.43
4	600309	万华化学	200,000	8,558,000.00	2.34
5	600009	上海机场	100,000	8,378,000.00	2.29
6	000858	五粮液	70,000	8,256,500.00	2.26
7	002311	海大集团	249,960	7,723,764.00	2.12
8	600004	白云机场	400,000	7,280,000.00	1.99
9	600519	贵州茅台	7,000	6,888,000.00	1.89
10	000651	格力电器	120,000	6,600,000.00	1.81

### 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	19,984,000.00	5.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	69,798,000.00	19.12
	其中：政策性金融债	9,795,000.00	2.68
4	企业债券	111,020,430.00	30.40
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	21,378,000.00	5.85
7	可转债（可交换债）	73,030,566.04	20.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	295,210,996.04	80.85

### 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（份）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	112273	15 金街 01	300,000	30,672,000.00	8.40
2	136554	16 中金 01	300,000	30,009,000.00	8.22
3	136606	16 信投 G2	300,000	29,994,000.00	8.21
4	101800263	18 萧山国资 MTN001	200,000	21,378,000.00	5.85
5	136519	16 陆嘴 01	200,000	20,146,000.00	5.52

## 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：本基金本报告期末未投资国债期货。

## 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是否出现被监管部门立案调查的， 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  
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	132,814.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,003,419.33
5	应收申购款	104,402.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,240,636.59

## 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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	113511	千禾转债	5,159,600.00	1.41
2	113014	林洋转债	3,828,400.00	1.05
3	113020	桐昆转债	3,697,678.40	1.01
4	128035	大族转债	3,455,014.72	0.95
5	132014	18 中化 EB	999,000.00	0.27

## 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股票。

## § 5 投资组合报告（转型前）

## 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	79,882,918.60	17.54
	其中：股票	79,882,918.60	17.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	308,592,039.64	67.77
	其中：债券	308,592,039.64	67.77
	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	62,804,176.97	13.79
8	其他资产	4,098,841.71	0.90
9	合计	455,377,976.92	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	24,858,000.00	5.66
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,804,000.00	1.32
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	36,303,000.00	8.27
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,917,918.60	2.94
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	79,882,918.60	18.19

### 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	601318	中国平安	300,000	24,933,000.00	5.68
2	000786	北新建材	700,000	13,251,000.00	3.02
3	601888	中国国旅	160,682	12,420,718.60	2.83
4	601166	兴业银行	600,000	11,370,000.00	2.59
5	600309	万华化学	200,000	8,798,000.00	2.00
6	600004	白云机场	400,000	5,804,000.00	1.32
7	000651	格力电器	50,000	2,809,000.00	0.64
8	002127	南极电商	45,200	497,200.00	0.11

### 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	29,928,000.00	6.81
2	央行票据	-	-

3	金融债券	69,926,000.00	15.92
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	170,104,120.00	38.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	21,034,000.00	4.79
7	可转债（可交换债）	17,599,919.64	4.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	308,592,039.64	70.26

### 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（份）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	143036	17 国证债	400,000	40,244,000.00	9.16
2	136554	16 中金 01	400,000	39,968,000.00	9.10
3	112878	19 侨城 01	400,000	39,764,000.00	9.05
4	112273	15 金街 01	300,000	30,519,000.00	6.95
5	136606	16 信投 G2	300,000	29,958,000.00	6.82

### 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：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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是否出现被监管部门立案调查的，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 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	59,143.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,988,016.24
5	应收申购款	51,681.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,098,841.71

### 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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	132014	18 中化 EB	4,032,000.00	0.92
2	128013	洪涛转债	151,716.94	0.03

### 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股票。

## § 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2019 年 4 月 27 日）持有的基金份额	401,883,143.31
报告期期间基金总申购份额	677,447.51
减：报告期期间基金总赎回份额	79,399,277.73
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	323,161,313.09

注：表内“总申购份额”含转换入、红利再投份额；“总赎回份额”含转换出份额。

## § 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

本报告期期初基金份额总额	804,467,238.95
本报告期基金总申购份额	847,505.29
减：本报告期基金总赎回份额	403,431,600.93
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	401,883,143.31

注：表内“总申购份额”含转换入份额；“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（转型后）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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（转型后）

### 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。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）

### 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盈安保本混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富盈安保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富盈安保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；



- 5、《汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内汇添富盈安保本混合型证券投资基金和汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 8、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](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

2019 年 7 月 17 日