

汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 09 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 22 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 18 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 2019 年 7 月 1 日起至 2019 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	添富民安增益定开混合	
基金主代码	005329	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 2 月 13 日	
报告期末基金份额总额	544,807,515.23 份	
投资目标	本基金在科学严格管理风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。	
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%+中债综合财富指数收益率*80%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，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，属于中等收益/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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	添富民安增益定开混合 A	添富民安增益定开混合 C

下属分级基金的交易代码	005329	005330
报告期末下属分级基金的份额总额	407,174,692.78 份	137,632,822.45 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7月1日-2019年9月30日）	
	添富民安增益定开混合 A	添富民安增益定开混合 C
1. 本期已实现收益	4,437,110.33	1,344,204.44
2. 本期利润	4,881,964.12	1,493,967.06
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0120	0.0109
4. 期末基金资产净值	434,454,399.63	145,899,168.78
5. 期末基金份额净值	1.0670	1.0601

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

添富民安增益定开混合 A

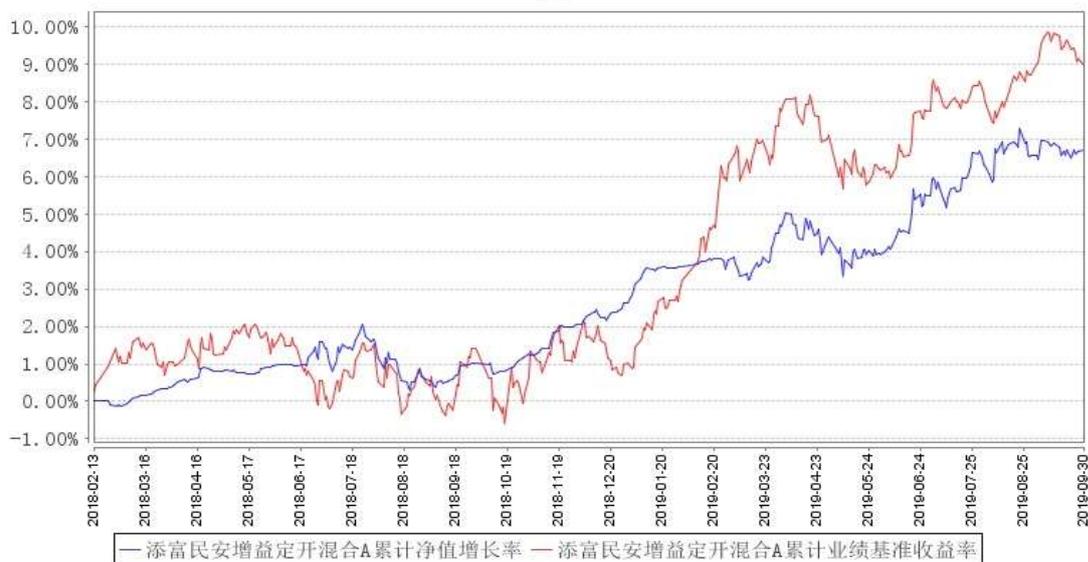
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.14%	0.20%	1.11%	0.19%	0.03%	0.01%

添富民安增益定开混合 C

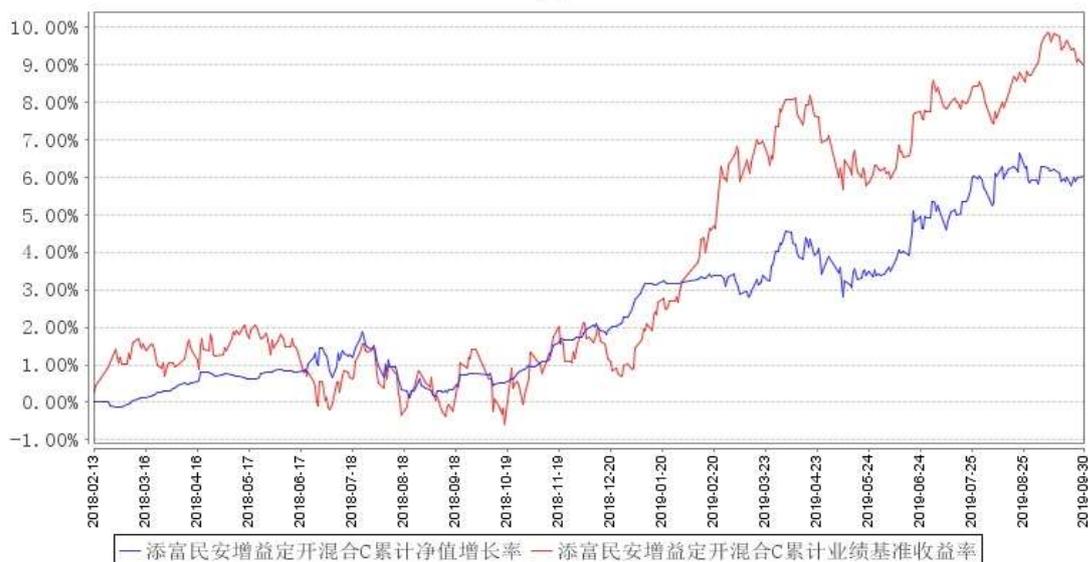
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.04%	0.20%	1.11%	0.19%	-0.07%	0.01%

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

添富民安增益定开混合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



添富民安增益定开混合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



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2018年2月13日）起6个月，建仓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		
胡昕炜	汇添富消费行业混合基金、添富价	2019年9月17日	-	8年	国籍：中国。 学历：清华大学工学硕士。

	<p>值创造定开混合、添富全球消费混合（QDII）基金、添富消费升级混合基金、添富民安增益定开混合基金的基金经理。</p>				<p>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 2019 年 8 月 28 日任添富添福吉祥混合基金的基金经理，2017 年 9 月 20 日至 2019 年 8 月 28 日任添富盈润混合基金的基金经理，2018 年 1 月 19 日至今任添富价值创造定开混合基金的基金经理，2018 年 9 月 21 日至今任添富全球消费混合（QDII）的基金经理，2018 年 12 月 21 日至今任添富消费升级混合基金的基金经理，2019 年 9 月 17 日至今任添富民安增益定开混合基金的基金经理。</p>
曾刚	<p>汇添富多元收益、可转换债券、实</p>	2019 年 9 月 17 日	-	18 年	<p>国籍：中国。学历：中国科技大学学士，</p>

	<p>业债债券、双利增强债券、汇添富安鑫智选混合、汇添富盈安混合（原汇添富盈安保本混合）基金、汇添富盈泰混合（原汇添富盈稳保本混合）基金、汇添富保鑫保本混合基金、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、添富年年泰定开混合基金、添富民安增益定开混合基金、汇添富睿丰混合（LOF）基金、汇添富新睿精选混合基金的基金经理。</p>			<p>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 天基金的基金经理，2013 年 1 月 24</p>
--	---	--	--	--

				<p>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 2019 年 8 月 28 日任汇添富 6 月红定期开放债券基金的基金经理，2016 年 3 月 16 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富稳健添利定期开放债券基金的</p>
--	--	--	--	--

				<p>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 日至今任汇添富盈泰混合（原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 2019 年 8 月 28 日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，2019 年 9 月 17 日至今任添富年年泰定开混合基金、添富民安增益定开混合基金、汇添富睿丰混合（LOF）基金、</p>
--	--	--	--	--

					汇添富新睿精选混合的基金经理。
赵鹏飞	汇添富多策略定开混合、汇添富高端制造股票基金、汇添富民丰回报混合基金、添富智能制造股票基金、添富悦享定开混合基金、汇添富内需增长股票基金、汇添富 3 年封闭竞争优势混合基金的基金经理。	2018 年 3 月 19 日	2019 年 9 月 17 日	11 年	国籍：中国。 曾任职于日信证券、光大证券和太平洋资产，担任高级投资经理等岗位。2015 年 8 月加入汇添富基金。2016 年 6 月 3 日至今任汇添富多策略定开混合基金的基金经理，2017 年 3 月 20 日至今任汇添富高端制造股票基金的基金经理，2017 年 9 月 27 日至今任汇添富民丰回报基金的基金经理，2017 年 9 月 29 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富弘安混合基金的基金经理，2017 年 9 月 29 日至 2019 年 9 月 17 日任汇添富睿丰混合（LOF）基金的基金经理，2018 年 3 月 19 日至 2019 年 9 月 17 日任添富民安增益定开混合基金的基金经理，2018 年 4 月 23 日至今任添富

					智能制造股票基金的基金经理，2019 年 1 月 31 日至今任添富悦享定开混合基金的基金经理，2019 年 7 月 31 日至今任汇添富内需增长股票基金的基金经理，2019 年 9 月 4 日至今任汇添富 3 年封闭竞争优势混合基金的基金经理。
胡娜	汇添富鑫瑞债券基金、添富鑫盛定开债基金、汇添富纯债（LOF）基金、添富鑫永定开债基金、汇添富盛安 39 个月定开债基金的基金经理。	2018 年 2 月 13 日	2019 年 9 月 17 日	10 年	国籍：中国。 学历：西南财经大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2009 年至 2012 年期间任职于华泰联合证券固定收益部，担任自营交易员职务；2012 年 11 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员、基金经理助理职务，自 2015 年 1 月 29 日至 2016 年 10 月 18 日任银华增强收益债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金和银华

				<p>永泰积极债券型证券投资基金基金经理。2015年5月14日至2016年10月18日任银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年5月21日至2016年10月18日任银华稳利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年11月加入汇添富基金管理股份有限公司任投资经理。2017年4月25日至2017年7月2日任添富年年泰定开混合基金、汇添富鑫瑞债券基金的基金经理助理，2017年7月3日至2019年9月17日任添富年年泰定开混合基金的基金经理，2017年7月3日至今任汇添富鑫瑞债券基金的基金经理，2018年2月13日至2019年9月17日任添富民安</p>
--	--	--	--	---

					增益定开混合基金的基金经理，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 7 月 6 日至今任汇添富纯债（LOF）基金的基金经理，2019 年 8 月 29 日至今任添富鑫永定开债基金的基金经理，2019 年 9 月 24 日至今任汇添富盛安 39 个月定开债基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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 7 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

三季度，中央保持定力，总体上稳住货币财政政策基调，为后续应对保留政策空间，但也在基建投资和促进消费等方面给予针对性的支持；预计 3 季度经济数据总体略偏弱，经济下行压力仍然存在。而从全球看，美国略强欧洲趋弱，近期也是国际地缘政治事件频出，可谓变局横生，更大的不确定性令市场对未来经济的预期难有稍许的乐观。

总体而言，债市相对受益于低迷的经济趋势，三季度呈现确定的收益率下行，但 9 月在猪价大幅上涨、地方专项债提前等因素推动下，收益率小幅回升，中债总财富指数上涨 1.38%。长端利率债出现较好的交易波段，信用利差出现结构性分化，信用违约事件仍在走高。

引导和推动居民消费增长，既有政策的支持，也是居民财富持续积累、注重生活品质、耐用消费品普及率达到较高水平、房地产投机受限等因素的综合效应；三季度消费板块在经营数据方面优于其他行业，白酒、旅游、娱乐、教育等行业的龙头个股保持强势，同期创新医药和电子元器件受益于行业基本面的改善，得到包括外资在内的机构追捧。可转债的估值吸引力减弱，波动下降，走势跟随正股，促转股动力有限，三季度中证转债指数上涨 3.62%。

本组合三季度净值上涨 1.14%，表现一般。本期内个股以稳健类大盘蓝筹为主，集中在银行、食品等行业，纯债部分保持稳定配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末添富民安增益定开混合 A 基金份额净值为 1.0670 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.14%；截至本报告期末添富民安增益定开混合 C 基金份额净值为 1.0601 元，本报告期

基金份额净值增长率为 1.04%；同期业绩比较基准收益率为 1.11%。

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	130,037,995.94	16.68
	其中：股票	130,037,995.94	16.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	609,253,888.20	78.13
	其中：债券	609,253,888.20	78.13
	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	23,714,270.67	3.04
8	其他资产	16,805,703.33	2.16
9	合计	779,811,858.14	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	67,768,483.53	11.68
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	-	-
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	28,329,068.75	4.88

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	10,390,963.20	1.79
R	文化、体育和娱乐业	23,549,480.46	4.06
S	综合	-	-
	合计	130,037,995.94	22.41

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	600036	招商银行	815,225	28,329,068.75	4.88
2	600519	贵州茅台	22,600	25,990,000.00	4.48
3	300144	宋城演艺	842,859	23,549,480.46	4.06
4	002821	凯莱英	101,700	11,985,345.00	2.07
5	600872	中炬高新	274,969	11,666,934.67	2.01
6	000858	五粮液	87,800	11,396,440.00	1.96
7	002044	美年健康	854,520	10,390,963.20	1.79
8	300326	凯利泰	399,000	5,905,200.00	1.02
9	688099	晶晨股份	15,597	802,621.62	0.14
10	603786	科博达	816	21,942.24	0.00

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	109,615,000.00	18.89
	其中：政策性金融债	89,619,000.00	15.44
4	企业债券	326,890,042.10	56.33
5	企业短期融资券	80,336,000.00	13.84
6	中期票据	61,167,000.00	10.54

7	可转债（可交换债）	2,139,846.10	0.37
8	同业存单	29,106,000.00	5.02
9	其他	-	-
10	合计	609,253,888.20	104.98

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	041900016	19 汇金 CP001	400,000	40,184,000.00	6.92
2	136305	16 紫金 02	400,000	39,992,000.00	6.89
3	190401	19 农发 01	400,000	39,840,000.00	6.86
4	101900510	19 中建交通 MTN001	300,000	30,681,000.00	5.29
5	101900552	19 中电投 MTN005	300,000	30,486,000.00	5.25

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：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：本基金本报告期末未投资国债期货。

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

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	31,894.64
2	应收证券清算款	4,679,303.56
3	应收股利	-
4	应收利息	12,094,505.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,805,703.33

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	128035	大族转债	1,020,912.40	0.18
2	113019	玲珑转债	729,433.70	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

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	688099	晶晨股份	802,621.62	0.14	新股流通受限
2	603786	科博达	21,942.24	0.00	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	添富民安增益定开混合 A	添富民安增益定开混合 C
报告期期初基金份额总额	407,174,692.78	137,632,822.45
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	-	-
报告期期末基金份额总额	407,174,692.78	137,632,822.45

§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

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民安增益定期开放混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富民安增益定期开放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、报告期内汇添富民安增益定期开放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

2019 年 10 月 22 日