

汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型 证券投资基金（LOF）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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 3 年封闭配售混合 (LOF)
场内简称	添富配售
基金主代码	501188
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 7 月 5 日
报告期末基金份额总额	14,515,424,805.96 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要投资通过战略配售取得的股票，在封闭运作期内主要采用战略配售策略和债券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*60%+中债总指数收益率*40%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。 本基金以投资战略配售股票为主要投资策略，需参与并接受发行人战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。
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（2019年7月1日-2019年9月30日）
1. 本期已实现收益	175,276,568.43
2. 本期利润	301,806,289.74
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0208
4. 期末基金资产净值	15,833,729,057.29
5. 期末基金份额净值	1.0908

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	1.94%	0.11%	0.14%	0.57%	1.80%	-0.46%

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3年封闭配售混合（LOF）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07月05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		
刘伟林	汇添富新兴消费股票基金、添富3年封闭配售混合（LOF）基金、汇添富新睿精选混合基金、汇添富睿丰混合（LOF）基金的基金经理。	2018年7月5日	-	11年	<p>国籍：中国。 学历：北京大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2008年7月加入汇添富基金任行业分析师；2010年5月至2011年3月在国家发展和改革委员会工作；2011年3月至2015年12月在汇添富基金担任高级策略分析师。2015年12月2日至今任汇添富新兴消费股票基金的基金经理，2018年7月5日至今任添富3年封闭配售混合（LOF）基金的基金经理，2019年8月19日至今任汇添富新睿精选混合基金的基金经理，2019年9月17日至今任汇添富睿丰混合（LOF）基金的基金经理。</p>
刘江	汇添富医疗服务混合基金、添富全球医疗混合（QDII）基	2018年7月5日	-	8年	<p>国籍：中国。 学历：清华大学工学硕士，德国亚琛工大工学硕士。相</p>

	金、添富 3 年封闭配售混合 (LOF) 基金、添富创新医药混合基金、汇添富科技创新混合基金的基金经理。				关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司任医药行业分析师，2015 年 6 月 18 日至今任汇添富医疗服务混合基金的基金经理，2017 年 8 月 16 日至今任添富全球医疗混合 (QDII) 基金的基金经理，2018 年 7 月 5 日至今任添富 3 年封闭配售混合 (LOF) 基金的基金经理，2018 年 8 月 8 日至今任添富创新医药混合基金的基金经理，2019 年 5 月 6 日至今任汇添富科技创新混合基金的基金经理。
杨璿	汇添富全球互联混合 (QDII) 基金、汇添富文体娱乐混合基金、添富 3 年封闭配售混合 (LOF) 基金、汇添富移动互联股票基金的基	2018 年 7 月 5 日	-	9 年	国籍：中国。学历：清华大学工程学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司，2010 年 8 月至 2017 年

	金经理				1 月担任公司的 TMT 行业分析师, 2017 年 1 月 25 日至今任汇添富全球互联混合 (QDII) 基金的基金经理, 2018 年 6 月 21 日至今任汇添富文体娱乐混合基金的基金经理, 2018 年 7 月 5 日至今任添富 3 年封闭配售混合 (LOF) 基金的基金经理, 2019 年 1 月 18 日至今任汇添富移动互联股票基金的基金经理。
何旻	汇添富安心中国债券基金、汇添富美元债债券 (QDII) 基金、添富 3 年封闭配售混合 (LOF) 基金、添富中债 1-3 年国开债基金、汇添富中债 1-3 年农发债基金的基金经理。	2018 年 7 月 5 日	-	21 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), 财务风险经理 (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。

				<p>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。</p> <p>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</p>
--	--	--	--	---

				<p>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2019年8月28日任汇添富6月红定期开放债券基金（原汇添富信用债债券基金）的基金经理， 2016年3月11日至2019年8月28日任汇添富盈鑫混合（原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6日至2019年8月28日任添富盈润混合基金的基金经理，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， 2018年7月5</p>
--	--	--	--	--

					<p>日至今任添富3年封闭配售混合（LOF）基金的基金经理，2019年4月15日至今任添富中债1-3年国开债基金的基金经理，2019年6月19日至今任汇添富中债1-3年农发债基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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

2019年6月之后，国内的消费品价格指数受到猪肉价格影响，逐月上升，在7、8月份到达近一年的高点2.8%。去除了食品和能源价格之后的核心CPI仍然在回落，降至2016年第一季度的水平。工业品价格指数PPI逐月回落，在7月份进入负值区间。中国制造业采购经理指数PMI在第三季度保持平稳，其中新订单和生产两个分项指数都略有反弹。投资数据方面，喜忧参半。房地产投资的同比增速在第三季度下降，而商品房销售增速有所回升。制造业投资累计同比增速继续回落，下降到3%以下。总体的固定资产投资累计同比增速在第三季度小幅回落，几个分项指数，除基础设施投资以外，同比都在回调。从房地产的细项数据上看，70个大中城市商品房价格指数、房屋新开工面积和商品房销售额都在第三季度下降。货币政策方面，第三季度，央行通过公开市场操作回收货币2300亿元。各期限逆回购利率与前两个季度保持不变。货币供应量仍在低位徘徊，但已经略有改善。M1同比增速在8月份达到3.40%，M2同比增速在8.20%。整个债券市场的资金较为宽松。人民币兑美元汇率在第三季度贬值幅度加大，约3.93%左右。第三季度各月份的外汇占款增加额均为负值。

第三季度，债券市场在8月份收益率快速下降，9月份出现一波调整。中债综合财富指数上涨1.40%。股票市场第三季度沪深300指数下跌0.29%。

本基金在第三季度积极争取主板和科创板的战略配售机会，经过努力，成功作为战略投资者配售了中国广核股票。债券资产方面，8月份积极加长久期，9月份降低久期，并增加了对高等级信用债的配置。

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1.0908元；本报告期基金份额净值增长率为1.94%，业绩比较基准收益率为0.14%。

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	1,082,318,674.28	6.83
	其中：股票	1,082,318,674.28	6.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,442,810,763.00	91.20
	其中：债券	14,442,810,763.00	91.20
	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	118,804,396.58	0.75
8	其他资产	192,600,557.76	1.22
9	合计	15,836,534,391.62	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	18,769,480.48	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	419,946,660.00	2.65
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	775,274.80	0.00
J	金融业	642,827,259.00	4.06
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	1,082,318,674.28	6.84

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	601319	中国人保	74,850,000	630,985,500.00	3.99
2	003816	中国广核	111,097,000	419,946,660.00	2.65
3	000651	格力电器	286,200	16,399,260.00	0.10
4	601939	建设银行	1,694,100	11,841,759.00	0.07
5	688018	乐鑫科技	6,264	778,176.72	0.00
6	688088	虹软科技	16,944	697,076.16	0.00
7	688020	方邦股份	7,643	566,881.31	0.00
8	688005	容百科技	17,937	553,177.08	0.00
9	688011	新光光电	8,807	418,948.99	0.00
10	603927	中科软	884	78,198.64	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	2,260,796,000.00	14.28
	其中：政策性金融债	1,540,954,000.00	9.73
4	企业债券	7,469,847,763.00	47.18
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,272,503,000.00	14.35
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	2,439,664,000.00	15.41
9	其他	-	-

10	合计	14,442,810,763.00	91.22
----	----	-------------------	-------

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	190405	19 农发 05	9,200,000	918,712,000.00	5.80
2	190210	19 国开 10	4,000,000	401,560,000.00	2.54
3	111910164	19 兴业银行 CD164	3,000,000	291,000,000.00	1.84
4	111817234	18 光大银行 CD234	3,000,000	290,010,000.00	1.83
5	101900950	19 华润 MTN005	2,200,000	221,342,000.00	1.40

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：报告期末本基金无国债期货持仓。

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	108,011.62
2	应收证券清算款	1,864,225.68
3	应收股利	-
4	应收利息	190,628,320.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	192,600,557.76

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

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	601319	中国人保	630,985,500.00	3.99	非公开发行流通受限
2	003816	中国广核	419,946,660.00	2.65	非公开发行流通受限
3	688018	乐鑫科技	778,176.72	0.00	新股流通受限
4	688088	虹软科技	697,076.16	0.00	新股流通受限
5	688020	方邦股份	566,881.31	0.00	新股流通受限
6	688005	容百科技	553,177.08	0.00	新股流通受限
7	688011	新光光电	418,948.99	0.00	新股流通受限

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	14,481,069,406.44
报告期期间基金总申购份额	34,355,399.52
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	14,515,424,805.96

注：总申购份额含红利再投。

§ 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 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）募集的文件；

2、《汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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