

汇添富全球移动互联网灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告

2019 年 03 月 31 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 04 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4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1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富全球互联混合(QDII)
交易代码	001668
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年01月25日
报告期末基金份额总额	222,511,598.30份
投资目标	本基金主要投资于全球移动互联主题相关公司的股票，通过对投资对象的精选和组合管理，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金资产配置策略及股票投资策略适用于境内市场投资、境外市场投资及港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票的投资。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出全球移动互联主题相关公司中商业模式清晰、竞争优势明显、具有长期持续增长模式且估值水平相对合理的上市公司，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。
业绩比较基准	50%*人民币计价的中证海外中国互联网指数收益率+50%*中证移动互联网指数收益率
风险收益特征	本基金为主要投资于全球移动互联主题相关公司股票的混合型基金，属于证券投资基金中高预期风险高预期收益的品种，其预期风险与预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。
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
-------	--------------

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	布朗兄弟哈里曼银行
	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
注册地址		140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		NY 10005

注：本基金无境外投资顾问。

§ 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 01 月 01 日 - 2019 年 03 月 31 日)
1. 本期已实现收益	-135,383.30
2. 本期利润	55,263,266.56
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2306
4. 期末基金资产净值	343,863,619.04
5. 期末基金份额净值	1.545

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。

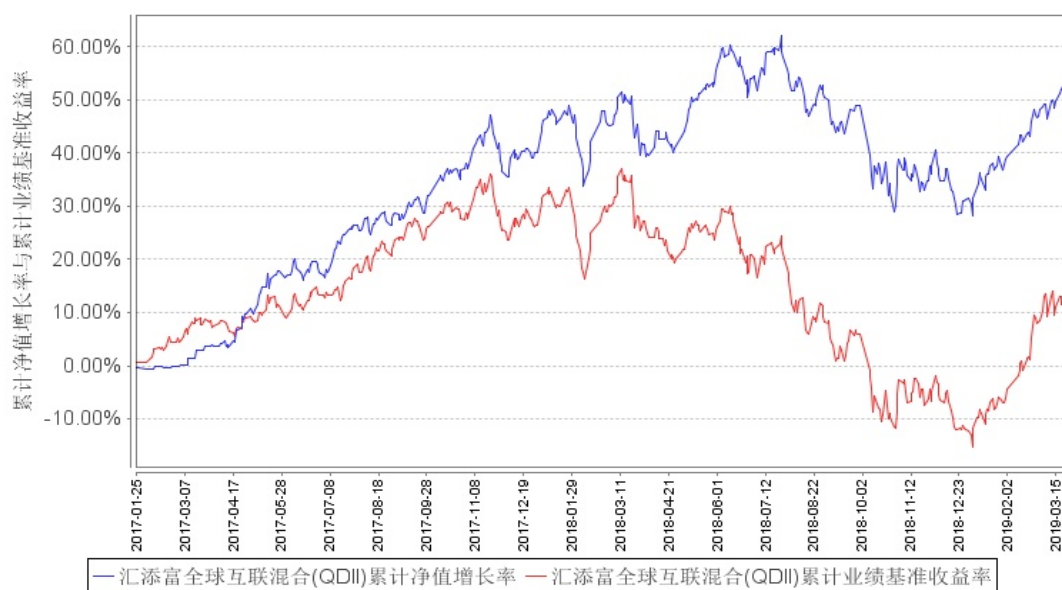
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	17.58%	0.95%	28.59%	1.65%	-11.01%	-0.70%

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

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（2017年1月25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		
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、汇添富移动互联网股票基金的基金经理	2017年1月25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网股票基金的基金经理。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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 2 次，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2019 年的全球股市开局超出了我们的预期，在经过 12 月的剧烈下跌后，美股、H 股、A 股等全球主要市场均迎来了较大幅度的反弹。

全球移动互联在投资策略与资产配置上未有重大变化，仓位维持在 75%-85%的区间，美股上市

公司占股票净资产的比例仍为最大，其次为 A 股上市公司，最后为 H 股上市公司；在投资主要脉络上，全球移动互联基金继续布局全球科技资产中成长处于中前期的 ABC 产业，即人工智能（AI）、大数据（Big Data）、云计算（Cloud Computing），并以移动互联网、部分电子制造及半导体作为辅助性投资脉络，同时在非风格池中配置中国的消费品及现代服务业龙头公司。

我们认为，ABC 带来的第三次科技产业浪潮（或第四次工业革命）的影响十分深远，社会与生活的运行效率有机会得到大幅提升，其中拥有优秀企业治理、持续创新、综合竞争优势显著的行业龙头有望为客户创造更多的价值，从而迎来数年的快速成长期。

截止到 2019 年 3 月 28 日，全球移动互联基金上涨 15.4%，其中由于美元/港币下跌负面影响人民币净值约 1.5%-2%，同期标普 500 指数上涨 12.3%、道琼斯指数上涨 10.3%、纳斯达克指数上涨 15.6%、恒生指数上涨 11.3%、上证综指上涨 20.1%、深证成指上涨 31.9%、沪深 300 上涨 23.8%、中小板指上涨 30.5%、创业板指上涨 30.1%。

本基金本报告期内上涨 17.58%，同期业绩比较基准上涨 28.59%。

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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	294,228,647.50	82.45
	其中：普通股	223,593,047.40	62.66
	优先股	-	-
	存托凭证	70,635,600.10	19.79
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	6,434,667.27	1.80
3	固定收益投资	118,526.10	0.03
	其中：债券	118,526.10	0.03
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	55,471,448.84	15.54
8	其他资产	601,368.37	0.17
9	合计	356,854,658.08	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 26,246,744.20 人民币，占期末净值比例 7.63%。

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	187,194,651.89	54.44
中国	72,114,033.79	20.97
香港	34,919,961.82	10.16
合计	294,228,647.50	85.57

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	9,483,963.84	2.76
25 非必需消费品	77,942,815.40	22.67
30 必需消费品	19,276,014.00	5.61
35 医疗保健	3,518,589.00	1.02
40 金融	5,367,259.49	1.56
45 信息技术	175,127,355.72	50.93
50 电信服务	3,512,650.05	1.02
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	294,228,647.50	85.57

注：1. 以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

2. 由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	纽约证券交易所	美国	17,000	20,884,960.28	6.07
2	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	22,950	18,225,719.32	5.30

3	AMAZON COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	1,195	14,328,862.75	4.17
4	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	00700 HK	香港联合交易所	香港	39,000	12,076,825.41	3.51
5	New Oriental Education & Technology Group Inc.	新东方教育科技集团	EDU US	纽约证券交易所	美国	16,300	9,887,922.54	2.88
6	VISA INC.	VISA 公司	V US	纽约证券交易所	美国	8,765	9,218,197.52	2.68
7	TAL Education Group	好未来教育集团	TAL US	纽约证券交易所	美国	35,350	8,588,094.44	2.50
8	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co., Ltd.	内蒙古伊利实业集团股份有限公司	600887 SH	上海证券交易所	中国	282,600	8,226,486.00	2.39
9	Facebook Inc		FB US	纳斯达克交易所	美国	6,700	7,520,127.67	2.19
10	AUTODESK INC	欧特克有限公司	ADSK US	纳斯达克交易所	美国	6,600	6,924,812.20	2.01

注：本表所使用的境外证券代码为彭博代码。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
未评级	118,526.10	0.03

注：本基金债券投资组合主要采用穆迪、标准普尔等国际权威评级机构提供的债券信用评级信息。

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	128035	大族转债	1,078	118,526.10	0.03

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。

5.8 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金融衍生品投资明

细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	PROSHARES ULTRAPRO SHORT QQQ	ETF	开放式	ProShares Trust	4,930,538.04	1.43
2	DIREXION DAILY SEMICON 3X	ETF	开放式	Direxion Shares ETF Trust	1,504,129.23	0.44

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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、处罚的情况。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	19,669.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	23,230.58
4	应收利息	1,979.25
5	应收申购款	556,489.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	601,368.37

5.10.4 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	118,526.10	0.03

5.10.5 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未存在流通受限的情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：

份

报告期期初基金份额总额	252,544,464.36
报告期期间基金总申购份额	23,701,250.95
减：报告期期间基金总赎回份额	53,734,117.01
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	222,511,598.30

注：总申购份额含红利再投份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富全球移动互联灵活配置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、报告期内汇添富全球移动互联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；
- 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 04 月 20 日