

汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 7 月 17 日

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。

基金托管人兴业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。

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 2019 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 添富鑫盛定开债 |
| 基金主代码 | 005410 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 4 月 16 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,009,999,000.00 份 |
| 投资目标 | 在科学严格管理风险的前提下，本基金力争创造超越业绩比较基准的较高收益。 |
| 投资策略 | 本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定类属资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。 |

| | | |
|-----------------|--------------------|-----------|
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 添富鑫盛定开债 A | 添富鑫盛定开债 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 005410 | 005411 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3,009,999,000.00 份 | -份 |

注:本基金 C 类份额为 0。

§ 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 4 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日) | |
|-----------------|---------------------------------------|-----------|
| | 添富鑫盛定开债 A | 添富鑫盛定开债 C |
| 1. 本期已实现收益 | 31,024,885.77 | - |
| 2. 本期利润 | 28,669,041.95 | - |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0095 | - |
| 4. 期末基金资产净值 | 3,049,580,852.95 | - |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0132 | - |

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、本基金 C 类份额为 0。

3.2 基金净值表现

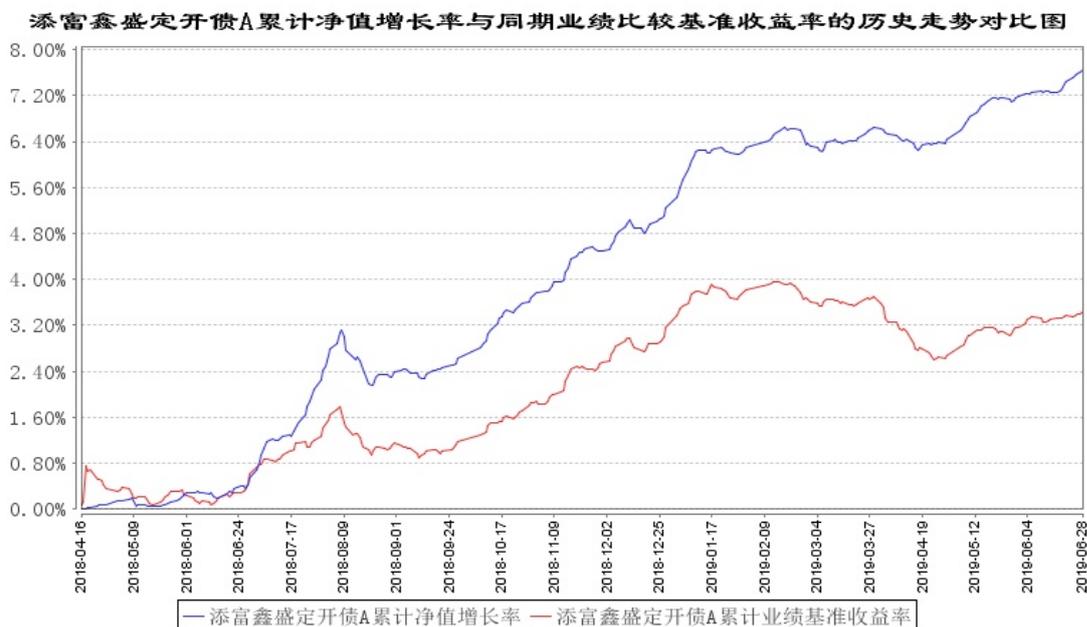
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

添富鑫盛定开债 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 | 0.95% | 0.04% | -0.24% | 0.06% | 1.19% | -0.02% |

注:本基金 C 类份额为 0。

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



注：本基金建仓为本《基金合同》生效日（2018年4月16日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金C类份额为0。

§ 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 | | |
| 胡娜 | 添富年年泰定开混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、添富民安增益定开混合基金、添富鑫盛定开债基金、汇添富纯债（LOF）基金的基金经理。 | 2018年4月16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 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>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永泰积极债券型证券投资基金基金经理。</p> <p>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有限公司任投资经理。</p> <p>2017 年 4 月 25 日至 2017 年 7 月 2 日任添富年年泰定开混合</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|-----|--|-----------------|---|-----|---|
| | | | | | <p>基金、汇添富鑫瑞债券基金的基金经理助理，2017 年 7 月 3 日至今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，</p> <p>2018 年 2 月 13 日至今任添富民安增益定开混合基金的基金经理，</p> <p>2018 年 4 月 16 日至今任添富鑫盛定开债基金的基金经理，</p> <p>2018 年 7 月 6 日至今任汇添富纯债（LOF）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</p> | 2018 年 4 月 16 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，</p> <p>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，</p> <p>2016 年 8 月 3 日至今任汇</p> |

| | | | | |
|--|---|--|--|---|
| | <p>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>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开债基金的基金经理，</p> |
|--|---|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 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

2019 年二季度，全球经济共振回落，美国经济数据下滑明显，减税刺激消退叠加贸易摩擦反复，美国制造业与消费均呈现颓势。中国经济二季度呈现小幅回落的态势，中采制造业 PMI 跌至荣枯线以下，工业增加值明显回落。企业盈利继续下滑，制造业投资下滑，地产基建托底经济，但随着房地产融资收紧，销售和开工面临下滑，地产周期仍处于下行阶段。另一方面，地方专项债可作为项目资金本，预计未来地方债发行额度有所提升，基建投资有望继续企稳回升，但基建仍是托底，在管控新增地方债务的背景下，难以扭转经济的下滑趋势，下半年经济仍面临较大的下行压力。

政策层面，二季度货币政策例会对当前的宏观经济和货币政策做出了描述，当前海外不确定性增加，货币政策需适时适度实施逆周期调节，外部环境的变化有利于货币政策保持宽松，流动性充裕，而防范化解重大风险特别是金融风险仍是重中之重，预计相关措施仍将渐进式推进，风险处置的过程也需要货币政策的保驾护航。二季度，债券收益率先上后下，全季度整体小幅震荡。10 年国债上行 9bp，10 年国开下行 4bp，3 年 AAA 中票上行 4bp，5 年 AAA 中票上行 2bp，3 年 AA+中票下行 1bp，5 年 AA+中票上行 1bp。二季度股市全面下跌，上证综指下跌 3.62%，深圳成指下跌 7.35%，创业板下跌 10.28%，中小板指下跌 10.32%。

本基金二季度根据行情预判对组合进行了结构优化，维持中性久期，提升了杠杆，并进行了利率债波段交易。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末添富鑫盛定开债券 A 基金份额净值为 1.0132 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.95%，同期业绩比较基准收益率为-0.24%。

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 4,538,713,000.00 | 96.41 |
| | 其中：债券 | 4,468,713,000.00 | 94.92 |
| | 资产支持证券 | 70,000,000.00 | 1.49 |
| 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 | 98,544,984.72 | 2.09 |
| 8 | 其他资产 | 70,529,055.17 | 1.50 |
| 9 | 合计 | 4,707,787,039.89 | 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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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 | 619,975,000.00 | 20.33 |
| | 其中：政策性金融债 | 509,037,000.00 | 16.69 |
| 4 | 企业债券 | 1,535,073,000.00 | 50.34 |
| 5 | 企业短期融资券 | 632,207,000.00 | 20.73 |
| 6 | 中期票据 | 1,128,391,000.00 | 37.00 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 553,067,000.00 | 18.14 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,468,713,000.00 | 146.54 |

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 | 190201 | 19 国开 01 | 1,400,000 | 139,944,000.00 | 4.59 |
| 2 | 190203 | 19 国开 03 | 1,400,000 | 139,104,000.00 | 4.56 |
| 3 | 180211 | 18 国开 11 | 1,200,000 | 121,440,000.00 | 3.98 |
| 4 | 101801323 | 18 国新控股 MTN003 | 1,000,000 | 101,290,000.00 | 3.32 |
| 5 | 112516 | 17 国信 01 | 1,000,000 | 100,940,000.00 | 3.31 |

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 139694 | 永熙优 04 | 500,000 | 50,000,000.00 | 1.64 |
| 2 | 139674 | 联易融 12 | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.33 |
| 3 | - | 19 融惠 4A | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.33 |

注：由于 19 融惠 4A 尚未在深交所上市，暂无正式代码。

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持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

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 | 138,175.83 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 70,390,879.34 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 70,529,055.17 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末无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

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

| 项目 | 添富鑫盛定开债 A | 添富鑫盛定开债 C |
|----------------|------------------|-----------|
| 报告期期初基金份额总额 | 3,009,999,000.00 | - |
| 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 | 3,009,999,000.00 | - |

注：总申购份额含红利再投份额。

本基金 C 类份额为 0。

§ 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

单位：份

| 项目 | 添富鑫盛定开债 A | 添富鑫盛定开债 C |
|------------------|---------------|-----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,000,000.00 | - |

| | | |
|---------------------------|---------------|---|
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 0.33 | - |

注:本基金于 2018 年 4 月 16 日成立。本公司于 2018 年 4 月 12 日用自有资金 10,001,000.00 元认购本基金份额 10,000,000.00 份,认购费用 1,000.00 元。符合招募说明书规定的认购费率。

7.2 基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人自有资金 | 10,000,000.00 | 0.33 | 10,000,000.00 | 0.33 | 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,000.00 | 0.33 | 10,000,000.00 | 0.33 | - |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|------------------|------|------|------------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | 1 | 2019 年 4 月 1 日至 | 2,999,999,000.00 | - | - | 2,999,999,000.00 | 99.67 |

| | | | | | | | |
|--|---|--------------------|---|---|---|---|---|
| | | 2019 年 6 月 30 日 | | | | | |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，很可能出现开放期最后一日基金资产净值加上当日净申购的基金份额对应的资产净值减去当日净赎回的基金份额对应的资产净值低于 5000 万元的情形，按照法律法规与《基金合同》的约定，本基金将面临提前终止基金合同的风险。若未触发前述提前终止情形，持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，本基金有可能在运作过程中资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p> | | | | | | | |

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2、《汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富鑫盛定期开放债券型发起式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、报告期内汇添富鑫盛定期开放债券型发起式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。

10.2 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

10.3 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 7 月 17 日