

汇添富科技创新灵活配置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	汇添富科技创新混合
基金主代码	007355
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 6 日
报告期末基金份额总额	880,436,212.67 份
投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，重点投资于科技创新相关的优质上市公司，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本

	基金还可根据法律法规参与融资。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。	
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率*60%+中债综合财富指数收益率*30%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*10%	
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	汇添富科技创新混合 A	汇添富科技创新混合 C
下属分级基金的交易代码	007355	007356
报告期末下属分级基金的份额总额	761,559,604.28 份	118,876,608.39 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)	
	汇添富科技创新混合 A	汇添富科技创新混合 C
1. 本期已实现收益	39,823,399.83	5,911,425.54
2. 本期利润	85,705,671.33	13,067,581.84
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1038	0.0996
4. 期末基金资产净值	848,294,910.69	131,951,474.10
5. 期末基金份额净值	1.1139	1.1100

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

汇添富科技创新混合 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	10.22%	0.92%	4.07%	0.75%	6.15%	0.17%

汇添富科技创新混合 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	9.97%	0.92%	4.07%	0.75%	5.90%	0.17%

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

汇添富科技创新混合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



汇添富科技创新混合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《基金合同》生效之日为 2019 年 5 月 6 日，截至本报告期末，基金成立未满 6 个月；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2019 年 5 月 6 日）起 6 个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

§ 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		
刘江	汇添富医疗服务混合基金、添富全球医疗混合(QDII)基金、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。	2019年5月6日	-	8年	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。
马翔	汇添富民营活力混合基金、汇添富科技创新混合基金的基金经理。	2019年5月6日	-	8年	国籍：中国。 学历：清华大学工学硕士。 从业经历： 2011年加入汇添富基金任行业分析师， 2016年3月11日至今任汇添富民营活力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。

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 年三季度，A 股市场整体平稳，成长股有结构性机会，本基金的主要比较基准新兴成指上涨 7.07%。本基金 5 月 6 日成立，报告期内，本基金匀速建仓；至 9 月底，股票仓位 92.12%，完成了建仓工作。

本基金坚持以企业基本面分析为立足点，寻找代表科技发展方向的主航道，并在相关行业内寻找能够成长为行业领袖的公司，中长期持股，分享企业成长增值。我们主要投资于医药、IT、高端制造三个科技创新板块，保持行业相对均衡；在每个板块内，选择竞争格局相对清晰的子行业，挑选竞争优势显著的龙头公司，在盈利增速和估值匹配的前提下进行投资布局。

医药板块占比约 20%，我们重点投资创新药研发、体外诊断、心血管器械等行业；IT 板块占比约 30%，我们重点投资金融 IT、B2B 电商、SaaS 服务等行业；高端制造板块占比约 30%，我们重点投资电子制造、石油机械、通信设备等行业。除此以外，我们还投资了一些处于成长期的消费品公司。具体选择标的，可参见基金持股分析章节。

本基金所选择的细分行业及其龙头企业，是能够代表未来中国科技创新发展方向的，并且在三季度都有一定涨幅；因为本基金执行匀速建仓策略，故而基金涨幅略低于相应股票涨幅。展望未来，我们认为这些公司的在未来 2~3 年都有较好的成长性，是可以持续做大的企业，可以为投资者带来持续回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富科技创新混合 A 基金份额净值为 1.1139 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.22%；截至本报告期末汇添富科技创新混合 C 基金份额净值为 1.1100 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.97%；同期业绩比较基准收益率为 4.07%。

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	902,983,598.11	90.90
	其中：股票	902,983,598.11	90.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	80,385,941.44	8.09
8	其他资产	10,059,260.25	1.01
9	合计	993,428,799.80	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人民币 94,242,906.81 元，占期末净值比例 9.61%。

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	512,080,641.35	52.24
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	20,425,681.20	2.08
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	209,265,470.85	21.35
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,399,347.00	0.55
M	科学研究和技术服务业	45,736,590.90	4.67
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	15,832,960.00	1.62
S	综合	-	-
	合计	808,740,691.30	82.50

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	13,453,930.16	1.37
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	14,571,286.02	1.49

G 工业	-	-
H 信息技术	36,224,829.84	3.70
I 电信服务	29,992,860.79	3.06
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	94,242,906.81	9.61

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。

5.3 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	600276	恒瑞医药	706,488	56,999,451.84	5.81
2	600570	恒生电子	660,360	48,820,414.80	4.98
3	603259	药明康德	527,527	45,736,590.90	4.67
4	603613	国联股份	662,324	40,620,330.92	4.14
5	000063	中兴通讯	1,229,300	39,349,893.00	4.01
6	00268	金蝶国际	4,862,000	36,224,829.84	3.70
7	000333	美的集团	676,170	34,552,287.00	3.52
8	603236	移远通信	204,042	34,432,087.50	3.51
9	603658	安图生物	386,102	34,173,888.02	3.49
10	002353	杰瑞股份	1,232,217	33,282,181.17	3.40

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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	146,656.39
2	应收证券清算款	9,895,566.71
3	应收股利	231.46
4	应收利息	16,805.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,059,260.25

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

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富科技创新混合 A	汇添富科技创新混合 C
报告期期初基金份额总额	853,575,774.04	138,273,397.82
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	92,016,169.76	19,396,789.43
报告期期末基金份额总额	761,559,604.28	118,876,608.39

注:其中“总申购份额”含红利再投、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

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科技创新灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
- 2、《汇添富科技创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富科技创新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、报告期内汇添富科技创新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 10 月 22 日