汇添富弘安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：招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。

基金托管人招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	汇添富弘安混合
基金主代码	501041
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 29 日
报告期末基金份额总额	71,515,872.39 份
投资目标	在有效控制风险的基础上，本基金充分挖掘市场潜在的投资机会，通过积极合理的资产配置，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将密切关注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，判断不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，以动态调整大类资产配置比例。在此基础上，灵活运用债券投资策略、股票精选策略等投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中债综合指数收益率×70%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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，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	招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	汇添富弘安混合 A	汇添富弘安混合 C
下属分级基金的场内简称	添富弘安	添富弘 C
下属分级基金的交易代码	501041	501042
报告期末下属分级基金的份额总额	47,371,997.08 份	24,143,875.31 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）	
	汇添富弘安混合 A	汇添富弘安混合 C
1.本期已实现收益	-334,843.63	-239,327.68
2.本期利润	753,763.10	313,962.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0138	0.0111
4.期末基金资产净值	51,281,425.16	25,719,851.15
5.期末基金份额净值	1.0825	1.0653

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

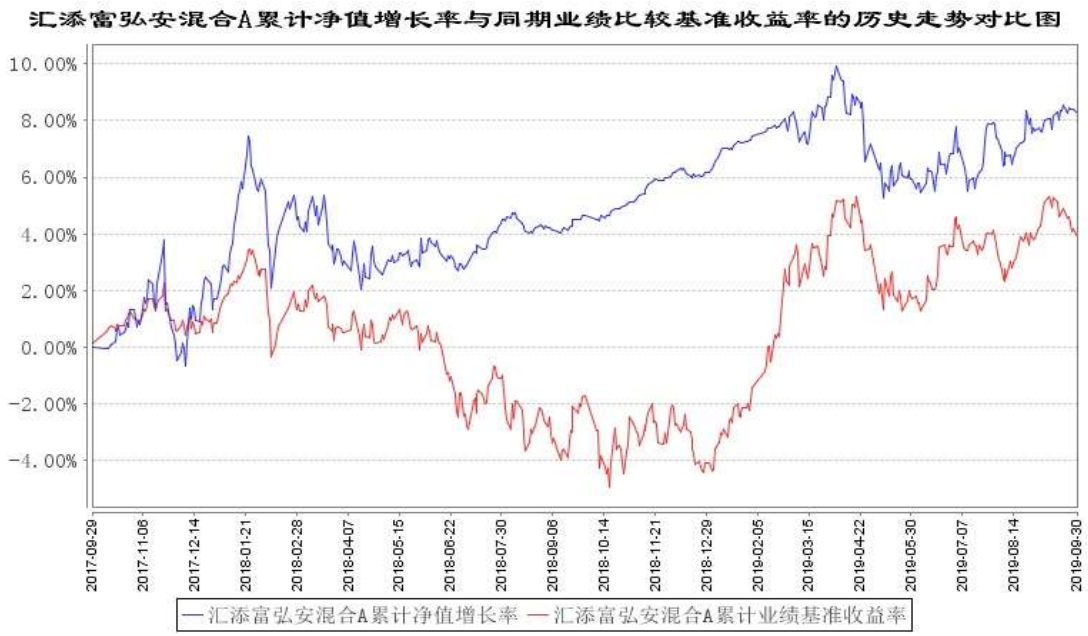
汇添富弘安混合 A

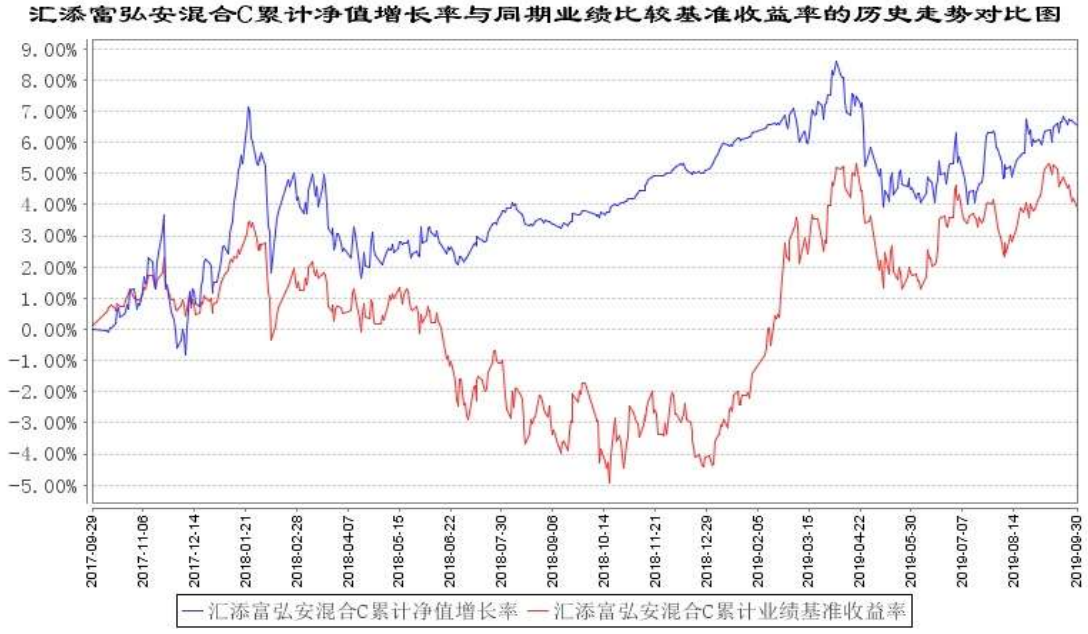
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.34%	0.30%	0.30%	0.28%	1.04%	0.02%

汇添富弘安混合 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	1.14%	0.30%	0.30%	0.28%	0.84%	0.02%

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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017 年 9 月 29 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		
吴江宏	汇添富可转换债券基金、汇添富	2019 年 8 月 28 日	-	8 年	国籍：中国，学历：厦门大学经济学硕

	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、汇添富鑫利定开债、汇添富绝对收益定开混合、汇添富民丰回报混合、添富鑫盛定开债、添富年年丰定开混合、汇添富双利债券、添富添福吉祥混合、添富盈润混合、汇添富弘安混合、汇添富 6 月红定期开放债券的基金经理。				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，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，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 2019 年 9 月 4 日任汇添富鑫益定开债基金的基金经理，2017 年 6 月 23 日至

					2019 年 8 月 28 日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 2019 年 8 月 29 日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，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，2019 年 8 月 28 日至今任添富添福吉祥混合、添富盈润混合、汇添富弘安混合、汇添富 6 月红定期开放债券的基金经理。
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	2017 年 9 月 29 日	2019 年 8 月 28 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

	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。				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。
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。	2017 年 9 月 29 日	2019 年 8 月 28 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），财务风险经理人（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。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。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。

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，基金管理人对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

基本面，经济下行压力仍大，通胀预期抬升。工业增加值同比 6 月冲高后，持续大幅走低。投资数据小幅下行。社融数据单月存在波动，整体处于宽信用区间。海外方面，全球流动性宽松延续，贸易和政治不确定性上升。

政策面，政治局会议明确经济下行压力加大，强调不将房地产作为短期刺激经济的手段。央行货币政策宽松不及市场预期，央行宣布 9 月全面降准 0.5%，但并没有进一步下调 MLF 利率。

三季度债券收益率先下后上，全季度看 10Y 国债收益率下行至 3.14%，信用债收益率普遍下行，其中短久期低等级的信用利差压缩显著。

三季度股票市场波动加大，沪深 300 指数下跌 0.29%，上证 50 指数下跌 1.12%，创业板指数上涨 7.68%，以电子和计算机为代表行业表现活跃。可转债估值进一步扩张，中证转债指数上涨 3.62%。

报告期内，组合仓位有所降低，主要配置低估值的龙头公司，个股和行业相对均衡。纯债部分，主要配置高等级信用债，久期中性偏短。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 级净值增长率为 1.34%，C 级净值增长率为 1.14%。

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	15,707,820.00	15.73
	其中：股票	15,707,820.00	15.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	78,799,100.00	78.89
	其中：债券	78,799,100.00	78.89
	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	3,755,350.64	3.76
8	其他资产	1,624,761.63	1.63
9	合计	99,887,032.27	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	9,689,520.00	12.58
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	3,871,700.00	5.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	930,600.00	1.21
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	1,216,000.00	1.58
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,707,820.00	20.40

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	601318	中国平安	30,000	2,611,200.00	3.39
2	600872	中炬高新	60,000	2,545,800.00	3.31
3	600519	贵州茅台	1,500	1,725,000.00	2.24
4	600660	福耀玻璃	80,000	1,718,400.00	2.23
5	600276	恒瑞医药	20,000	1,613,600.00	2.10
6	000858	五 粮 液	10,000	1,298,000.00	1.69
7	002142	宁波银行	50,000	1,260,500.00	1.64
8	002044	美年健康	100,000	1,216,000.00	1.58

9	601888	中国国旅	10,000	930,600.00	1.21
10	000661	长春高新	2,000	788,720.00	1.02

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	20,141,200.00	26.16
	其中：政策性金融债	20,141,200.00	26.16
4	企业债券	57,457,520.00	74.62
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,200,380.00	1.56
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	78,799,100.00	102.33

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	190210	19 国开 10	100,000	10,039,000.00	13.04
2	143018	18 金地 07	75,000	7,708,500.00	10.01
3	122352	12 广汽 03	60,000	6,028,200.00	7.83
4	155201	19 陆债 01	50,000	5,056,500.00	6.57
5	143554	18 国信一	50,000	5,038,000.00	6.54

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:本基金报告期末无股指期货持仓。

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中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	35,314.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,589,447.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,624,761.63

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	113518	顾家转债	1,152,400.00	1.50

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	汇添富弘安混合 A	汇添富弘安混合 C
报告期期初基金份额总额	61,166,110.91	33,131,964.33
报告期期间基金总申购份额	365,249.44	230,389.67
减:报告期期间基金总赎回份额	14,159,363.27	9,218,478.69
报告期期末基金份额总额	47,371,997.08	24,143,875.31

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弘安混合型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富弘安混合型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富弘安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、报告期内汇添富弘安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