

嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券 投资基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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。

本报告期中的财务资料未经审计。

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 | 嘉实新添康定期混合 | |
| 基金主代码 | 005603 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018 年 9 月 27 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 133,404,227.47 份 | |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。 | |
| 投资策略 | 本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四个角度进行综合分析，在控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。 | |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50% +中债综合财富指数收益率×50%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 嘉实基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 嘉实新添康定期混合 A | 嘉实新添康定期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 005603 | 005604 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 128,946,726.39 份 | 4,457,501.08 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) | 报告期(2019年7月1日 - 2019年9月30日) |
|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 嘉实新添康定期混合 A | 嘉实新添康定期混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 2,146,602.28 | 53,778.58 |
| 2. 本期利润 | 3,839,670.26 | 102,453.26 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0185 | 0.0172 |
| 4. 期末基金资产净值 | 134,888,649.81 | 4,634,497.51 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0461 | 1.0397 |

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）嘉实新添康定期混合 A 收取认（申）购费用和赎回费，嘉实新添康定期混合 C 不收取认（申）购费用但收取赎回费、计提销售服务费；（3）上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

嘉实新添康定期混合 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 | 1.91% | 0.26% | 0.63% | 0.48% | 1.28% | -0.22% |

嘉实新添康定期混合 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 | 1.74% | 0.26% | 0.63% | 0.48% | 1.11% | -0.22% |

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

嘉实新添康定期混合 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



图 1：嘉实新添康定期混合 A 基金份额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

(2018 年 9 月 27 日至 2019 年 9 月 30 日)

嘉实新添康定期混合 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



图 2：嘉实新添康定期混合 C 基金份额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

(2018 年 9 月 27 日至 2019 年 9 月 30 日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

§ 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 | | |
| 刘宁 | 本基金、嘉实增强信用定期债券、嘉实如意宝定期债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实稳荣债券、嘉实新添华定期混合、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实润泽量化定期混合、嘉实润和量化定期混合、嘉实新添荣定期混合、嘉实战略配售混合、嘉实致盈债券、嘉实新添元定期混合、嘉实新添益定期混合基金经理 | 2018年9月27日 | - | 15年 | 经济学硕士，2004年5月加入嘉实基金管理有限公司，在公司多个业务部门工作，2005年开始从事投资相关工作，曾任债券专职交易员、年金组合组合控制员、投资经理助理、机构投资部投资经理。 |

注：（1）基金经理的任职日期是指本基金基金合同生效之日；（2）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

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内宏观经济仍在筑底阶段，国内基本面来看，经济数据出现了一定程度的下行，社融数据偏弱，工业增加值走低，投资小幅下行，经济整体依赖地产的韧性，基建和制造业投资仍在低位徘徊。7月30号政治局会议进一步明确了房地产不作为稳定经济的手段，地产调控持续偏紧，特别是对房地产信托融资、海外融资等加强了监管，这也使得短期内经济下行的压力仍然较大。同时，7-8月猪肉价格超季节性大幅上涨，推升CPI达到2.8%的位置，这也使得四季度至明年一季度的通胀预期大幅抬升，国内呈现类滞涨态势。海外方面，全球需求走弱以及经贸、地缘争端不断，使得外围基本面压力进一步加大，7-9月美联储连续两次降息，全球多个经济体也纷纷采取跟随降息。国内货币面临两难，外围宽松环境和内部通胀以及调结构的压力，均制约了大幅放松的空间，三季度央行重点工作在于推动利率传导机制的疏通，以鼓励资金脱虚入实并防止再度大量流入地产领域。8月中旬央行开始推进LPR改革，并在下旬首次报价中实现1年期和5年期LPR较现行基准利率分别下调10bp和5bp。9月央行宣布全面降准，释放资金8000亿，定向降准1000亿。

债券市场先涨后跌。7-8月中长端利率下行约20bp，曲线平坦化较为明显。信用债好于利率债，信用利差持续压缩。9月受降准后公开市场操作不及预期、资金面紧平衡、美债大幅上行等因素影响，长端利率较低点震荡上行20Bp左右。信用债尤其是中低等级信用债表现依然较好。

权益市场方面，与二季度投资者集中拥抱消费类行业不同，三季度随着科创板上市，同时在5G、自主可控等一系列科技主题的推动下，科技板块迎来了显著上涨，而基建投资未超预期且地产维持高压调控也使得相关的传统周期类行业表现较差，市场整体风格上，高成长显著占优。行业方面，电子、医药、计算机和食品饮料等涨幅居前，钢铁、有色金属、商贸零售和建筑则表现靠后。

报告期内本基金继续本着稳健投资原则，在风险和收益之间进行平衡。中高等级信用债持仓

为主获取稳定收益，并积极参与利率债交易，提升组合业绩。维持中性股票仓位，积极参与股票 IPO 及可转债一级市场申购提升收益。三季度末组合年度开放，全面降低仓位应对开放。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实新添康定期混合 A 基金份额净值为 1.0461 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.91%；截至本报告期末嘉实新添康定期混合 C 基金份额净值为 1.0397 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.74%；业绩比较基准收益率为 0.63%。

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 | 25,382,788.16 | 11.38 |
| | 其中：股票 | 25,382,788.16 | 11.38 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 141,502,404.40 | 63.42 |
| | 其中：债券 | 141,502,404.40 | 63.42 |
| | 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 | 47,940,271.91 | 21.49 |
| | 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 | 5,549,940.57 | 2.49 |
| 8 | 其他资产 | 2,749,766.76 | 1.23 |
| 9 | 合计 | 223,125,171.80 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 14,922,234.26 | 10.70 |
| D | 电力、热力、燃气 及水生产和供应业 | 2,005,380.00 | 1.44 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| 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 | 3,033,937.40 | 2.17 |
| J | 金融业 | 5,421,236.50 | 3.89 |
| 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 | 25,382,788.16 | 18.19 |

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 | 48,000 | 3,872,640.00 | 2.78 |
| 2 | 600104 | 上汽集团 | 161,800 | 3,847,604.00 | 2.76 |
| 3 | 601818 | 光大银行 | 786,400 | 3,098,416.00 | 2.22 |
| 4 | 002410 | 广联达 | 79,200 | 2,810,808.00 | 2.01 |
| 5 | 000895 | 双汇发展 | 105,800 | 2,613,260.00 | 1.87 |
| 6 | 601229 | 上海银行 | 248,430 | 2,322,820.50 | 1.66 |
| 7 | 000651 | 格力电器 | 40,500 | 2,320,650.00 | 1.66 |
| 8 | 600483 | 福能股份 | 234,000 | 2,005,380.00 | 1.44 |
| 9 | 000063 | 中兴通讯 | 32,300 | 1,033,923.00 | 0.74 |
| 10 | 688036 | 传音控股 | 15,889 | 806,843.42 | 0.58 |

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 | 34,978,532.00 | 25.07 |
| | 其中：政策性金融债 | 34,978,532.00 | 25.07 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|--------|
| 4 | 企业债券 | 76,032,872.40 | 54.49 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 30,456,000.00 | 21.83 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 35,000.00 | 0.03 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 141,502,404.40 | 101.42 |

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(张) | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 1280101 | 12 中石油 06 | 100,000 | 10,316,000.00 | 7.39 |
| 2 | 101801174 | 18 光大集团 MTN001 | 100,000 | 10,217,000.00 | 7.32 |
| 3 | 143725 | 18 光明 01 | 100,000 | 10,189,000.00 | 7.30 |
| 4 | 143764 | 18 电投 05 | 100,020 | 10,185,036.60 | 7.30 |
| 5 | 136053 | 15 南航 01 | 100,680 | 10,173,714.00 | 7.29 |

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

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

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

报告期末，本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

(1) 2018 年 10 月 8 日，根据上海银监局行政处罚信息公开表（沪银监罚决字（2018）49 号），因违规向其关系人发放信用贷款，上海银监局对上海银行股份有限公司处以责令改正，并

处罚款 1091460.03 元的行政处罚。2018 年 10 月 18 日,根据上海银监局行政处罚信息公开表(沪银监罚决字〔2018〕54 号),因对某同业资金违规投向资本金不足的房地产项目合规性审查未尽的违法违规事实,上海银监局对上海银行股份有限公司处以责令改正,并处罚款 50 万元的行政处罚。

2018 年 12 月 7 日,根据中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银保监银罚决字〔2018〕10 号),因内控管理严重违反审慎经营规则;以误导方式违规销售理财产品;以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品;违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务;同业投资违规接受担保;通过同业投资或贷款虚增存款规模等违法违规事实,中国银行保险监督管理委员会 2018 年 11 月 9 日对中国光大银行股份有限公司处以没收违法所得 100 万元,罚款 1020 万元,合计 1120 万元的行政处罚。

本基金投资于“上海银行(601229)”、“光大银行(601818)”的决策程序说明:基于对上海银行、光大银行基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于“上海银行”、“光大银行”股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中,其他八名证券发行主体无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。

5.11.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的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 | 56,800.83 |
| 2 | 应收证券清算款 | 473,070.79 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,219,895.14 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,749,766.76 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金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 | 占基金资产净值 | 流通受限情况说明 |
|----|------|------|----------|---------|----------|
|----|------|------|----------|---------|----------|

| | | | 允价值（元） | 比例（%） | |
|---|--------|------|------------|-------|---------|
| 1 | 688036 | 传音控股 | 806,843.42 | 0.58 | 科创板新股锁定 |

注：根据上海证券交易所 2019 年 6 月 8 日发布的《关于转发〈上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议〉的通知》（上证函（2019）936 号），通过摇号抽签方式抽取公募产品、社保基金、养老金、企业年金基金、保险资金和合格境外机构投资者资金等 6 类中长线资金对象中 10% 的账户，中签账户的管理人承诺中签账户获配股份锁定，持有期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 嘉实新添康定期混合 A | 嘉实新添康定期混合 C |
|-------------------------------|----------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 207,223,506.37 | 5,957,939.63 |
| 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 | 78,276,779.98 | 1,500,438.55 |
| 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 | 128,946,726.39 | 4,457,501.08 |

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，基金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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；

(6) 报告期内嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2019 年 10 月 22 日