

# 汇添富民丰回报混合型证券投资基金

## 2019 年第 4 季度报告

2019 年 12 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 1 月 21 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 01 月 17 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 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 汇添富民丰回报混合  |
| 基金主代码      | 004270   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2017 年 9 月 27 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 306,063,646.41 份   |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。  |
| 投资策略       | 本基金的投资策略主要包含资产配置策略、债券投资策略和股票投资策略等。本基金在保证资产配置符合基金合同规定的前提下，采用 CPPI (Constant Proportion Portfolio Insurance) 恒定比例组合保险策略来实现本金保值和增值的目标。投资过程中，基金管理人需在风险类资产投资风险加大和收益增强这两者之间寻找适当的平衡点，即确定适当的 |

|                 |   |                 |
|-----------------|---|-----------------|
|                 | 风险乘数，力求既能够保证投资组合风险可控，又能尽量为投资者创造更多收益。                      |                 |
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率*20%+中债综合指数收益率*80%                            |                 |
| 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，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           | 中国民生银行股份有限公司  |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 汇添富民丰回报混合 A   | 汇添富民丰回报混合 C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 004270  | 004271          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 295,193,759.46 份  | 10,869,886.95 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 10 月 1 日-2019 年 12 月 31 日） |               |
|-----------------|---------------------------------------|---------------|
|                 | 汇添富民丰回报混合 A                           | 汇添富民丰回报混合 C   |
| 1. 本期已实现收益      | 3,576,430.03                          | 146,960.57    |
| 2. 本期利润         | 6,119,270.72                          | 240,997.14    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0204                                | 0.0186        |
| 4. 期末基金资产净值     | 343,281,924.01                        | 12,647,188.72 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1629                                | 1.1635        |

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

汇添富民丰回报混合 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 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|
|    |        |           |            |              |     |     |

|       |       |       |       |       |        |       |
|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
|       |       |       |       | ④     |        |       |
| 过去三个月 | 1.77% | 0.24% | 1.97% | 0.15% | -0.20% | 0.09% |

汇添富民丰回报混合 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 | 1.67%  | 0.24%     | 1.97%      | 0.15%         | -0.30% | 0.09% |

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

汇添富民丰回报混合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



汇添富民丰回报混合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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年9月27日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

## § 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、汇添富保鑫混合（原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 | 2017年9月27日  | -    | 8年     | 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，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混合（原汇添富保鑫 |

|     |  |                 |   |      |   |
|-----|--|-----------------|---|------|---|
|     | <p>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。</p>              |                 |   |      | <p>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。</p> |
| 赵鹏飞 | <p>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、汇添富内需增长股票基金、汇添</p> | 2017 年 9 月 27 日 | - | 11 年 | <p>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</p>   |

|  |                              |  |  |  |
|--|------------------------------|--|--|--|
|  | <p>富 3 年封闭竞争优势混合基金的基金经理。</p> |  |  | <p>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。</p> |
|--|------------------------------|--|--|--|

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 管理人对报告期内本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

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司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成交量的 5% 的情况有 11 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度，经济呈弱企稳格局。固定资产投资增速持平，前期盈利低迷导致制造业投资微降，基建累计同比回落，地产投资继续降速。通胀方面，自 9 月猪价拉动 CPI 破 3% 后，CPI 一路上行，但市场也逐渐形成结构性通胀预期。金融数据方面，社融存量增速稳定，结构表现较好，信贷规模和结构边际改善、非标融资降幅继续收窄。

四季度债券收益率先上后下。9、10 月在贸易战缓和、通胀升温及货币宽松预期下降的影响下，债市利率大幅上行 20BP 左右。随着 11 月初央行意外下调 MLF 利率，市场对货币宽松预期回归，叠加年末配置盘需求推动下，收益率开始下行，短端利率下行明显。

四季度上证 50 指数上涨 5.71%，沪深 300 指数上涨 7.39%，中证 500 指数上涨 6.61%。除部分医药、消费龙头公司受政策等影响滞涨外，低估值价值型龙头公司整体表现较好，传媒、消费电子、新能源产业链的优质公司在景气好转预期下有较好表现。四季度，中证可转债指数上涨



6.6%，受年底配置需求推动，可转债估值大幅扩张，并有泡沫化的迹象。

报告期内，股票维持较高仓位，主要配置低估值的价值股。纯债部分，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

截至本报告期末汇添富民丰回报混合 A 基金份额净值为 1.1629 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.77%；截至本报告期末汇添富民丰回报混合 C 基金份额净值为 1.1635 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.67%；同期业绩比较基准收益率为 1.97%。

#### 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              | 74,339,210.41  | 20.84        |
|    | 其中：股票             | 74,339,210.41  | 20.84        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 275,425,654.12 | 77.21        |
|    | 其中：债券             | 275,425,654.12 | 77.21        |
|    | 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      | 1,866,506.32   | 0.52         |
| 8  | 其他资产              | 5,088,344.83   | 1.43         |
| 9  | 合计                | 356,719,715.68 | 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              | 5,475,000.00  | 1.54  |
| C | 制造业              | 22,120,312.73 | 6.21  |
| 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              | 36,187,096.88 | 10.17 |
| K | 房地产业             | 2,029,000.00  | 0.57  |
| 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          | 8,527,800.80  | 2.40  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -             | -     |
| S | 综合               | -             | -     |
|   | 合计               | 74,339,210.41 | 20.89 |

### 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  | 600036 | 招商银行 | 530,000 | 19,917,400.00 | 5.60         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 10,000  | 11,830,000.00 | 3.32         |
| 3  | 600872 | 中炬高新 | 260,500 | 10,250,675.00 | 2.88         |
| 4  | 002044 | 美年健康 | 572,720 | 8,527,800.80  | 2.40         |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 399,966 | 7,919,326.80  | 2.22         |
| 6  | 002142 | 宁波银行 | 200,000 | 5,630,000.00  | 1.58         |
| 7  | 601088 | 中国神华 | 300,000 | 5,475,000.00  | 1.54         |
| 8  | 001914 | 招商积余 | 100,000 | 2,029,000.00  | 0.57         |
| 9  | 601916 | 浙商银行 | 294,195 | 1,370,948.70  | 0.39         |
| 10 | 601077 | 渝农商行 | 211,111 | 1,349,421.38  | 0.38         |

### 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 | 22,945,856.00 | 6.45         |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 2  | 央行票据      | -              | -     |
| 3  | 金融债券      | 45,900,000.00  | 12.90 |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -     |
| 4  | 企业债券      | 154,661,000.00 | 43.45 |
| 5  | 企业短期融资券   | 19,934,000.00  | 5.60  |
| 6  | 中期票据      | -              | -     |
| 7  | 可转债（可交换债） | 31,984,798.12  | 8.99  |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 275,425,654.12 | 77.38 |

### 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  | 143529 | 18 海通 02 | 200,000 | 20,470,000.00 | 5.75         |
| 2  | 143526 | 18 老窖 01 | 200,000 | 20,464,000.00 | 5.75         |
| 3  | 143670 | 18 中煤 03 | 200,000 | 20,424,000.00 | 5.74         |
| 4  | 136519 | 16 陆嘴 01 | 200,000 | 20,194,000.00 | 5.67         |
| 5  | 136515 | 16 疏浚 02 | 200,000 | 20,138,000.00 | 5.66         |

### 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：本基金本报告期内未投资股指期货。

### 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 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。

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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   | 84,942.56    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 4,897,468.76 |
| 5  | 应收申购款   | 105,933.51   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 5,088,344.83 |

### 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（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------------|--------------|
| 1  | 113021 | 中信转债     | 3,959,900.00 | 1.11         |
| 2  | 113014 | 林洋转债     | 3,558,100.00 | 1.00         |
| 3  | 110045 | 海澜转债     | 3,046,200.00 | 0.86         |
| 4  | 132004 | 15 国盛 EB | 1,988,200.00 | 0.56         |
| 5  | 128035 | 大族转债     | 1,489,523.12 | 0.42         |
| 6  | 113011 | 光大转债     | 1,246,600.00 | 0.35         |
| 7  | 113522 | 旭升转债     | 1,244,000.00 | 0.35         |
| 8  | 113509 | 新泉转债     | 1,200,300.00 | 0.34         |
| 9  | 128061 | 启明转债     | 1,046,000.00 | 0.29         |
| 10 | 113511 | 千禾转债     | 611,150.00   | 0.17         |
| 11 | 113518 | 顾家转债     | 346,566.00   | 0.10         |
| 12 | 113022 | 浙商转债     | 247,977.60   | 0.07         |

### 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 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 601916 | 浙商银行 | 1,370,948.70   | 0.39         | 新股流通受限   |
| 2  | 601077 | 渝农商行 | 925,090.28     | 0.26         | 新股流通受限   |

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 汇添富民丰回报混合 A    | 汇添富民丰回报混合 C   |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初 基金 份额总额             | 306,841,686.25 | 15,032,310.51 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 568,961.81     | 1,524,985.11  |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 12,216,888.60  | 5,687,408.67  |
| 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               | 295,193,759.46 | 10,869,886.95 |

注: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

| 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 10 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 134,239,305.53 | -    | -          | 134,239,305.53 | 43.86    |
|  | 2              | 2019 年 10 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 134,239,305.53 | -    | -          | 134,239,305.53 | 43.86    |
| 个人   | -              | -                                 | -              | -    | -          | -              | -        |
| 产品特有风险   |                |                                   |                |      |            |                |          |
| <p>1、持有人大会投票权集中的风险<br/>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<br/>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,基金份额持有人将无法及时赎回所持有的全部基金份额。</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。

**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。

**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，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续 60 个工作日低于 5000 万元。根据法律法规与《基金合同》的约定，本基金将面临提前终止基金合同的风险。

## § 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民丰回报混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富民丰回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富民丰回报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、报告期内汇添富民丰回报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 层 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](http://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

2020 年 1 月 21 日