

嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券  
投资基金  
2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 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：2021 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 19 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 2020 年 10 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 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	22,406,286.94 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	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>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。</p> <p>具体包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。</p>
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	21,673,073.73 份	733,213.21 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（2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 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	13,037,917.83	491,440.24
2. 本期利润	4,430,342.11	152,156.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1873	0.1887
4. 期末基金资产净值	33,332,163.92	1,112,191.90
5. 期末基金份额净值	1.5380	1.5169

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）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 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	9.68%	0.75%	7.33%	0.50%	2.35%	0.25%
过去六个月	22.56%	1.06%	12.55%	0.66%	10.01%	0.40%
过去一年	40.69%	1.15%	15.22%	0.70%	25.47%	0.45%
自基金合同生效起至今	53.80%	0.78%	31.74%	0.68%	22.06%	0.10%

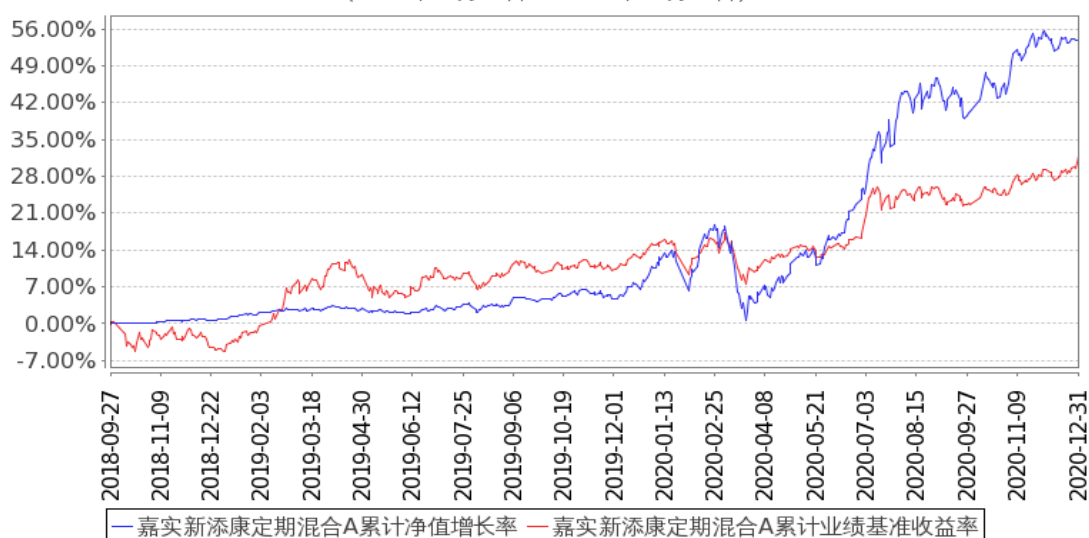
## 嘉实新添康定期混合 C

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	9.52%	0.75%	7.33%	0.50%	2.19%	0.25%
过去六个月	22.19%	1.06%	12.55%	0.66%	9.64%	0.40%
过去一年	39.85%	1.15%	15.22%	0.70%	24.63%	0.45%
自基金合同生效起至今	51.69%	0.78%	31.74%	0.68%	19.95%	0.10%

### 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

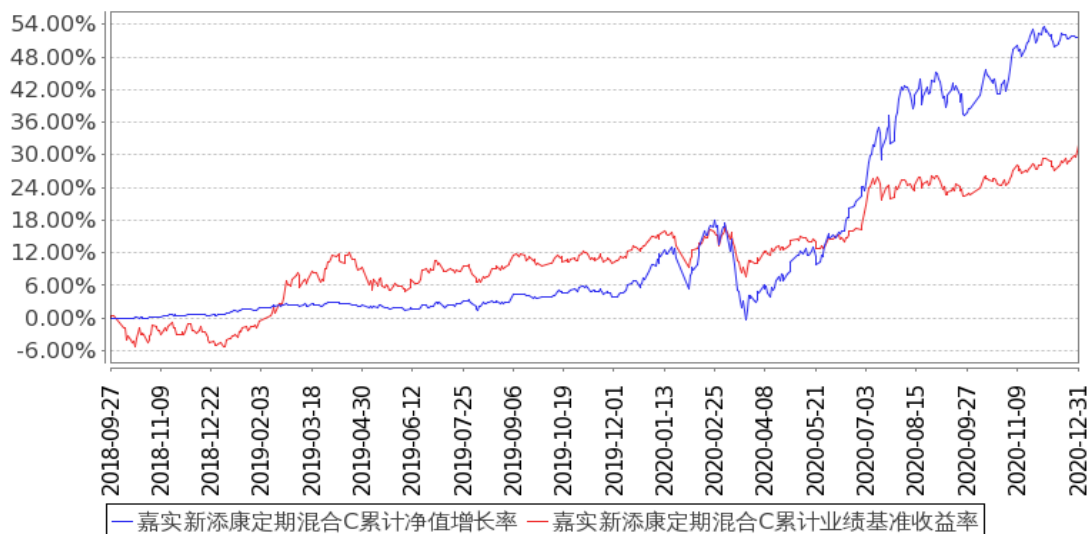
#### 嘉实新添康定期混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018年09月27日至2020年12月31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

(2018年09月27日至2020年12月31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个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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、嘉实新起点混合、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实新添华定期混合、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、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、嘉实致宁3个月定开纯债债券、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券基金经理	2018年9月27日	-	16年	2004年5月加入嘉实基金管理有限公司，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，现任债券基金经理。经济学硕士，具有基金从业资格。

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从《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

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，海外疫情延续甚至出现病毒变异，部分国家再次升级疫情防控措施，国内点状疫情多发，虽然疫苗取得重大进展，但短期受制于疫苗接种的一些担忧，实际对风险偏好提升有限；倍受关注的美国大选、英国脱欧、中欧投资协定相继落地，国际环境不确定性下降，海外制造业持续复苏，但受疫情冲击速度有所放缓，主要经济体量化宽松仍持续。

国内经济复苏延续且进程好于海外，经济内生动力增强，工业生产持续高增，11月工业增加值同比增速上升至7%，刚刚公布的12月pmi为51.9，仍在高位，地产投资和工业生产维持强势，可选消费和现场服务业继续恢复，表现出供需双强状态，同时cpi、ppi均录得负值。

政策面：国内货币政策和财政政策继续由宽松向正常化水平回归，季度内呈现边际放松，主要体现在延续三季度以来持续数月的MLF加量续作，11月违约事件对信用债市场冲击明显，市场

融资功能下降，央行加大对资金面呵护，债券市场平稳跨年。

权益市场：报告期内上证综指震荡走强并在年底创出反弹新高。结构上顺周期类资产在四季度整体跑赢；而高估值高久期的成长类资产表现则出现较大幅度分化，新能源和军工板块持续上涨，高端白酒伴随提价预期继续成为机构资金的抱团主流，而其他景气度一般的二线科技品类及必选医药则出现了显著回调。

债券市场报告期内先抑后扬，振幅较大，前期在货币政策边际收紧、风险偏好提升等因素下大幅上行，存单利率远超 MLF 利率，后续在资金面宽松及央行投放下回落，信用事件冲击引发收益率二次冲高，随后走出明显分化行情，利率及中高等级信用债表现优于中低等级信用债。季度维度国债收益率曲线有不同幅度下行，交易活跃的国开债收益率曲线中短端下行幅度较大，中低等级信用债面临重定价压力。

报告期内本基金由于规模仍旧小及股票仓位相对略高，对日常交易和流动性安排提出了较高要求，需要在组合流动性、收益性上做平衡，组合在结合自身判断的同时增加对资产配置模型的考量，在大类资产配置之间进行调整。报告期内组合即将满足自动清盘条款，季度末进行了资产变现，通过逆回购提高资金效率。

#### 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 1.5380 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.68%；截至本报告期末嘉实新添康定期混合 C 基金份额净值为 1.5169 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.52%；业绩比较基准收益率为 7.33%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金存在连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2020-10-13 至 2020-12-31；未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形。

## § 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	-	-
	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	33,000,000.00	95.33
	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	1,594,649.61	4.61
8	其他资产	21,544.65	0.06
9	合计	34,616,194.26	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

无。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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

无。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。



### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

### 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的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

#### 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	16,025.42
2	应收证券清算款	15,894.25
3	应收股利	-
4	应收利息	-10,375.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,544.65

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

**§ 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	44,487,410.20	1,611,274.30
报告期期间基金总申购份额	436,333.77	45,686.44
减：报告期期间基金总赎回份额	23,250,670.24	923,747.53
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	21,673,073.73	733,213.21

**§ 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**

无。

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

无。

**§ 8 影响投资者决策的其他重要信息**

2021 年 1 月 6 日，本基金管理人发布《关于嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算及基金合同终止的公告》：截至 2021 年 1 月 5 日日终，本基金的基金资产净值低于 5000 万元，且本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，本基金管理人将自 2021 年 1 月 6 日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序，终止本基金基金合同。

**§ 9 备查文件目录****9.1 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。

## 9.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

## 9.3 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

2021 年 1 月 21 日