

# 汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

### (2020年5月21日更新)

**基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司**

**基金托管人：中国银行股份有限公司**

#### 重要提示

汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金（基金简称：汇添富盈泰混合；基金代码：002959；以下简称“本基金”）由汇添富盈稳保本混合型证券投资基金变更而来。本基金基金合同于2019年8月13日正式生效。

汇添富盈稳保本混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会2016年4月11日《关于准予汇添富盈稳保本混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】744号文）注册公开募集。基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

汇添富盈稳保本混合型证券投资基金于2016年8月1日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《汇添富盈稳保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年8月3日正式生效。

汇添富盈稳保本混合型证券投资基金每三年为一个保本周期，第一个保本周期自基金合同生效日起至三个公历年后的对应日止，如该对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一个工作日。第一个保本周期自2016年8月3日起至2019年8月5日止。依据《汇添富盈稳保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，汇添富盈稳保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期时，未能符合本基金存续条件，汇添富盈稳保本混合型证券投资基金变更为“汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金”。

基金管理人保证《汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会备案,但中国证监会对汇添富盈稳保本混合型证券投资基金变更为本基金的备案,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品投资风险、参与融资等。

本基金更新招募说明书“基金的投资”章节中有关“风险收益特征”的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述,代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行“销售适当性风险评价”,不同的销售机构采用的评价方法也不同,因此销售机构的基金产品“风险等级评价”与“基金的投资”章节中“风险收益特征”的表述可能存在不同,投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

本基金为混合型基金,其预期风险收益低于股票型基金,高于货币市场基金和债券型基金。

投资有风险,投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》、基金产品资料概要及《基金合同》等信息披露文件,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券,中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债券的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。信用风险指发债主体违约

的风险，是中小企业私募债券最大的风险。流动性风险是由于中小企业私募债券交投不活跃导致的投资者被迫持有到期的风险。市场风险是未来市场价格（利率、汇率、股票价格、商品价格等）的不确定性带来的风险，它影响债券的实际收益率。这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或者超过 50%的除外。

本次招募说明书主要涉及基金经理信息的更新，更新所载内容截止日为 2020 年 5 月 21 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 12 月 31 日。

## 一、基金管理人

### 一、基金管理人简况

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼

法定代表人：李文

成立时间：2005 年 2 月 3 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2005]5 号

注册资本：人民币 132,724,224 元

联系人：李鹏

联系电话：021—28932888

股东名称及其出资比例：

股东名称	股权比例
东方证券股份有限公司	35.412%
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	24.656%
上海上报资产管理有限公司	19.966%
东航金控有限责任公司	19.966%
合计	100%

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员

李文先生，2015年4月16日担任董事长。国籍：中国，厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长，汇添富资产管理(香港)有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处科长，中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局杏林支局副行长、副局长，中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处长，东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理，稽核总部总经理，东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理，汇添富基金管理股份有限公司督察长。

程峰先生，2016年11月20日担任董事。国籍：中国，上海交通大学工商管理硕士。现任上海报业集团副总经理，上海上报资产管理有限公司董事长，上海文化产权交易所股份有限公司董事长，上海瑞力投资基金管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会团委副书记、书记，上海机械进出口(集团)有限公司副总裁，上海市对外经济贸易委员会技术进口处副处长，上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长、处长，上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任，上海国际集团有限公司行政管理总部总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长，上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。

林福杰先生，2018年3月21日担任董事。国籍：中国，上海交通大学工商管理硕士。现任东航金控有限责任公司总经理、党委副书记、东航集团财务有限责任公司董事长。曾任东航期货有限责任公司部门经理，东航集团财务有限

责任公司副总经理，国泰人寿保险有限责任公司副总经理，东航金控有限责任公司党委书记、副总经理。

张晖先生，2015年4月16日担任董事，总经理。国籍：中国，上海财经大学经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理，汇添富资本管理有限公司董事长。历任申银万国证券研究所高级分析师，富国基金管理有限公司研究主管和基金经理，汇添富基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监，曾担任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

林志军先生，2015年4月16日担任独立董事。国籍：中国香港，厦门大学经济学博士，加拿大Saskatchewan大学工商管理理学硕士。现任澳门科技大学副校长兼商学院院长、教授、博导。历任福建省科学技术委员会计划财务处会计，五大国际会计师事务所Touche Ross International(现为德勤)加拿大多伦多分所审计员，厦门大学会计师事务所副主任会计师，厦门大学经济学院讲师、副教授，伊利诺大学(University of Illinois)国际会计教育与研究中心访问学者，美国斯坦福大学(Stanford University)经济系访问学者，加拿大Lethbridge大学管理学院会计学讲师、副教授(tenured)，香港大学商学院访问教授，香港浸会大学商学院会计与法律系教授，博导，系主任。

杨燕青女士，2011年12月19日担任独立董事，国籍：中国，复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑，第一财经研究院院长，国家金融与发展实验室特邀高级研究员，上海政协委员，《第一财经日报》创始编委之一，第一财经频道高端对话节目《经济学人》等栏目创始人和主持人，《波士堂》等栏目资深评论员。2002-2003年期间受邀成为约翰-霍普金斯大学访问学者。

魏尚进(Shangjin Wei)先生，2020年1月9日担任独立董事，国籍：美国，加州大学伯克利分校博士。现任复旦大学泛海国际金融学院访问教授、哥伦比亚大学终身讲席教授。曾任哈佛大学肯尼迪政府学院助理教授、副教授，世界银行顾问，国际货币基金组织工作贸易与投资处处长、研究局助理局长。

## 2、监事会成员

任瑞良先生，2004年10月20日担任监事，2015年6月30日担任监事会主席。国籍：中国，大学学历，会计师、非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上报资产管理有限公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务

中心财务主管，文汇新民联合报业集团文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理等。

王如富先生，2015年9月8日担任监事。国籍：中国，硕士研究生，注册会计师。现任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任。历任申银万国证券计划统筹总部综合计划部专员、发展协调办公室专员，金信证券规划发展总部总经理助理、秘书处副主任（主持工作），东方证券研究所证券市场战略资深研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

毛海东先生，2015年6月30日担任监事，国籍：中国，国际金融学硕士。现任东航金控有限责任公司总经理助理兼财富管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责任公司，东航集团财务有限责任公司。

王静女士，2008年2月23日担任职工监事，国籍：中国，中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部，东航金控有限责任公司研究发展部。

林旋女士，2008年2月23日担任职工监事，国籍：中国，华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监，汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生，2013年8月8日担任职工监事，国籍：中国，北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司，泰科电子（上海）有限公司能源事业部。

### 3、高管人员

李文先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

张晖先生，2015年6月25日担任总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

雷继明先生，2012年3月7日担任副总经理。国籍：中国，工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理，中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011年12月加盟汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

娄焱女士，2013年1月7日担任副总经理。国籍：中国，金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京

与上海代表处工作，负责投资银行、证券投资研究，以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

袁建军先生，2015年8月5日担任副总经理。国籍：中国，金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理，汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理，并于2014年至2015年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。

李骁先生，2017年3月3日担任副总经理。国籍：中国，武汉大学金融学硕士。历任厦门建行计算机处副处长，厦门建行信用卡部副处长、处长，厦门建行信息技术部处长，建总行北京开发中心负责人，建总行信息技术管理部副总经理，建总行信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任，建总行信息技术管理部资深专员（副总经理级）。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席技术官。

李鹏先生，2015年6月25日担任督察长。国籍：中国，上海财经大学经济学博士，历任上海证监局主任科员、副处长，上海农商银行同业金融部副总经理，汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

#### 4、基金经理

##### （1）现任基金经理

李云鑫先生，国籍：中国，学历：清华大学化工硕士，9年证券从业经验。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰君安证券、国信证券行业分析师，2015年9月加入汇添富基金任行业分析师。2020年3月3日至今任汇添富达欣混合、汇添富熙和混合基金的基金经理助理，2020年3月18日至2020年5月20日任汇添富盈泰混合基金的基金经理助理，2020年4月14日至今任汇添富多元收益债券基金的基金经理助理，2020年5月20日至今任汇添富盈泰混合基金的基金经理。

##### （2）历任基金经理

吴江宏先生，2016年8月3日至2020年3月23日任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

曾刚先生，2016年8月3日至2020年5月20日任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

#### 5、投资决策委员会

主席：袁建军（副总经理）

成员：韩贤旺先生（首席经济学家）、王栩（总经理助理，权益投资总监）、陆文磊（总经理助理，固定收益投资总监）、劳杰男（研究总监）

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2019 年 12 月 31 日，中国银行已托管 764 只证券投资基金，其中境内基金 722 只，QDII 基金 42 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

## 三、相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### （1）直销机构

##### 1) 汇添富基金管理股份有限公司直销中心

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市浦东新区樱花路 868 号建工大唐国际广场 A 座 7 楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932893

传真：（021）50199035 或（021）50199036

联系人：陈卓膺

客户服务电话：400-888-9918（免长途话费）

网址：[www.99fund.com](http://www.99fund.com)

邮箱：[guitai@htffund.com](mailto:guitai@htffund.com)

##### 2) 汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统（[trade.99fund.com](http://trade.99fund.com)）

#### （2）代销机构

本基金的其他场外销售机构请详见基金管理人官网公示的销售机构信息表。基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并在基金管理人网站公示。

## 二、登记机构

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市浦东新区樱花路 868 号建工大唐国际广场 A 座 7 楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932888

传真：（021）28932876

联系人：韩从慧

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

经办律师：黎明、孙睿

联系人：孙睿

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

邮政编码：100738

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

业务联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、许培菁

#### 四、基金的名称

本基金名称：汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金。

基金简称：汇添富盈泰混合

基金代码：002959

#### 五、基金的类型

本基金为混合型证券投资基金。

#### 六、基金的投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过积极主动的资产配置，充分挖掘各大类资产投资机会，力争实现基金资产的中长期稳健增值。

#### 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、股票期权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)。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。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

## 八、基金的投资策略

### 1、资产配置策略

本基金综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素（其中，基本面因素包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、固定资产投资总量、发电量等宏观经济统计数据；政策面因素包括存款准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等货币政策、政府购买总量、转移支付水平以及税收政策等财政政策；市场面因素包括市场参与者情绪、市场资金供求变化、市场 P/E 与历史平均水平的偏离程度等），结合全球宏观经济形势，研判国内外经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，对投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种进行战略配置和动态调整，以规避或分散市场风险，力争实现基金资产的中长期稳健增值。

### 2、股票投资策略

在股票投资中，本基金主要采用“自下而上”的策略，精选出具有持续竞争优势且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得当期的较高投资收益。

本基金精选组合成份股的过程具体分为二个层次进行：第一层次，企业竞争优势评估。通过深入的案头分析和实地调研，发现在经营中具有一个或多个方面的持续竞争优势（如公司治理优势、管理层优势、生产优势、市场优势、技术优势、政策性优势等）、管理出色且财务透明稳健的企业；第二层次，估值精选。基于定性定量分析、动态静态指标相结合的原则，采用内在价值、相

对价值、收购价值相结合的估值方法，选择股价没有充分反映价值的股票进行投资及组合管理。

### 3、债券投资策略

#### (1) 利率策略

本基金将通过全面研究和分析宏观经济运行情况和金融市场资金供求状况变化趋势及结构，结合对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向的研判，从而预测出金融市场利率水平变动趋势。在此基础上，结合期限利差与凸度综合分析，制定出具体的利率策略。

具体而言，本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标，分析宏观经济情况，建立经济前景的场景模拟，进而预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时，本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势与结构，对影响资金面的因素进行详细分析与预判，建立资金面的场景模拟。

在此基础上，本基金将结合历史与经验数据，区分当前利率债收益率曲线的期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位，判断收益率曲线参数变动的程度与概率，即对收益率曲线平移的方向，陡峭化的程度与凸度变动的趋势进行敏感性分析，以此为依据动态调整投资组合。如预期收益率曲线出现正向平移的概率较大时，即市场利率将上升，本基金将降低组合久期以规避损失；如出现负向平移的概率较大时，则提高组合久期；如收益率曲线过于陡峭时，则采用骑乘策略获取超额收益。本基金还将在对收益率曲线凸度判断的基础上，利用蝶形策略获取超额收益。

#### (2) 信用策略

信用债券收益率是与其具有相同期限的无风险收益率加上反映信用风险收益的信用利差之和。基准收益率主要受宏观经济环境的影响，信用利差收益率主要受对应的信用利差曲线以及该信用债券本身的信用变化的影响，因此本基金分别采用基于信用利差曲线变化策略和基于信用变化的策略。

##### ①基于信用利差曲线变化的策略

本基金将以下两方面分析信用利差的变化情况，并采取相应的投资策略：

宏观经济环境对信用利差的影响：当宏观经济向好时，信用利差可能由于发债主体盈利能力改善而收窄；反之，信用利差可能扩大。本基金将根据宏观经济的变化情况，加大对信用利差收窄的债券的投资比例。

市场供求关系对信用利差的影响：信用债券的发行利率、企业的融资需求等都将影响债券的供给，而政策的变化、其他类属资产的收益率等也将影响投资者对信用债券的需求，从而对信用利差产生影响。本基金将综合分析信用债券市场容量、市场形势预期、流动性等因素，在具有不同信用利差的品种间进行动态调整。

### ②基于信用变化的策略

本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估并作出及时反应。

为了准确评估发债主体的信用风险，我们设计了定性和定量相结合的内部信用评级体系。内部信用评级体系遵循从“行业风险”—“公司风险”（包括公司背景、公司行业地位、企业盈利模式、公司治理结构和信息披露状况、及企业财务状况）—“外部支持”（外部流动性支持能力及债券担保增信）—“得到评分”的评级过程。其中，定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析，主要包括四个方面：盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析。定性分析包括所有非定量信息的分析和研究，作为定量分析的重要补充，能够有效提高定量分析的准确性。

本基金内部的信用评级体系定位为即期评级，侧重于评级的准确性，从而为信用产品的实时交易提供参考。本基金会对宏观、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪，发掘相对价值被低估的债券，以便及时有效地抓住信用债券本身信用变化带来的市场交易机会。

### ③个券选择策略

本基金将根据信用债券市场的收益率水平，在综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上，建立收益率曲线预测模型和信用利差曲线预测模型，并通过这些模型进行估值，重点选择具备以下特征的信用债券：较高到期收益率、较高当期收入、预期信用质量将改善，以及价值尚未被市场充分发现的个券。

### （3）可转换债券投资策略

对于本基金中可转债的投资，本基金主要采用可转债相对价值分析策略。

由于可转债兼具债性和股性，其投资风险和收益介于股票和债券之间，可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。

其次，在进行可转债筛选时，本基金还对可转债自身的基本面要素进行综合分析，这些基本面要素包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等，形成对基础股票的价值评估。本基金将可转债自身的基本面分析和其基础股票的基本面分析结合在一起，最终确定投资的品种。

#### (4) 中小企业私募债券投资策略

本基金将在严格控制信用风险的基础上，通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券，并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险，实现投资收益的最大化。

本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级以深入的企业基本面分析为基础，结合定性和定量方法，注重对企业未来偿债能力的分析评估，对中小企业私募债券进行分类，以便准确地评估中小企业私募债券的信用风险程度，并及时跟踪其信用风险的变化。

本基金对中小企业私募债券的投资策略以持有到期为主，在综合考虑债券信用资质、债券收益率和期限的前提下，重点选择资质较好、收益率较好的中小企业私募债券进行投资。

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

#### 4、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人

将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人将在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

#### 5、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征，有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，以在控制风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

在资产支持证券的选择上，本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的策略。“自上而下”投资策略指在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，本基金运用数量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对收益率走势及其收益和风险进行判断。“自下而上”投资策略指运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。

#### 7、融资投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

#### 8、股票期权投资策略

基金管理人在进行股票期权投资前将建立股票期权投资决策小组，负责股票期权投资管理的相关事项。本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。

#### 9、国债期货投资策略

本基金将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

### 九、基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率\*50%+中债综合指数收益率\*50%

选择该业绩比较基准，是基于以下因素：

- (1) 沪深 300 指数和中债综合指数合理、透明；
- (2) 沪深 300 指数和中债综合指数具有较高的知名度和市场影响力；
- (3) 沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数；
- (4) 沪深 300 指数和中债综合指数有一定市场覆盖率，并且不易被操纵；

(5) 基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用该业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制机构调整或停止上述指数的发布，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场中出现更具有代表性的业绩比较基准，或者更科学的业绩比较基准，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，变更本基金的业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

## 十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会、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的法律责任。

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2020年03月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。本报告期自2019年1月1日起至12月31日止。其中，2019年8月13日起，“汇添富盈稳保本混合型证券投资基金”转型为“汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金”。汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同及托管协议即日生效。

## §1 投资组合报告（转型后）

## 1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	93,637,483.21	24.69
	其中：股票	93,637,483.21	24.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	277,941,364.26	73.27
	其中：债券	277,941,364.26	73.27
	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	2,336,651.58	0.62
8	其他各项资产	5,411,223.20	1.43
9	合计	379,326,722.25	100.00

## 1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	2,124,958.75	0.64
C	制造业	43,717,704.52	13.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,987,241.74	0.60
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,767,500.00	1.75
H	住宿和餐饮业	3,091,500.00	0.94
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	26,058,394.31	7.89
K	房地产业	3,236,000.00	0.98
L	租赁和商务服务业	7,567,783.10	2.29
M	科学研究和技术服务业	86,400.79	0.03

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	93,637,483.21	28.37

### 1.2.2 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。

### 1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	601166	兴业银行	500,000	9,900,000.00	3.00
2	601318	中国平安	100,000	8,546,000.00	2.59
3	601888	中国国旅	80,000	7,116,000.00	2.16
4	600519	贵州茅台	5,000	5,915,000.00	1.79
5	000333	美的集团	100,000	5,825,000.00	1.76
6	600309	万华化学	100,000	5,617,000.00	1.70
7	000786	北新建材	200,000	5,090,000.00	1.54
8	600507	方大特钢	400,000	4,024,000.00	1.22
9	600426	华鲁恒升	200,000	3,974,000.00	1.20
10	600872	中炬高新	100,000	3,935,000.00	1.19
11	601628	中国人寿	99,929	3,484,524.23	1.06
12	002050	三花智控	200,000	3,466,000.00	1.05
13	600048	保利地产	200,000	3,236,000.00	0.98
14	600009	上海机场	40,000	3,150,000.00	0.95
15	600258	首旅酒店	150,000	3,091,500.00	0.94
16	000538	云南白药	30,000	2,682,900.00	0.81
17	600276	恒瑞医药	30,000	2,625,600.00	0.80
18	600004	白云机场	150,000	2,617,500.00	0.79
19	003816	中国广核	562,958	1,987,241.74	0.60
20	601088	中国神华	100,000	1,825,000.00	0.55
21	002142	宁波银行	50,000	1,407,500.00	0.43
22	601916	浙商银行	294,195	1,370,948.70	0.42
23	601077	渝农商行	211,111	1,349,421.38	0.41
24	002127	南极电商	41,410	451,783.10	0.14
25	600968	海油发展	102,375	299,958.75	0.09

26	688166	博瑞医药	8,041	206,171.24	0.06
27	688025	杰普特	4,655	178,565.80	0.05
28	688310	迈得医疗	3,276	94,905.72	0.03
29	002967	广电计量	2,723	86,400.79	0.03
30	603983	丸美股份	1,392	83,561.76	0.03

#### 1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	7,790,618.88	2.36
2	600519	贵州茅台	5,581,695.00	1.69
3	300015	爱尔眼科	3,790,334.60	1.15
4	600507	方大特钢	3,656,607.00	1.11
5	600426	华鲁恒升	3,259,175.00	0.99
6	601628	中国人寿	3,244,115.31	0.98
7	600009	上海机场	3,125,103.00	0.95
8	600258	首旅酒店	3,088,953.00	0.94
9	002050	三花智控	3,065,012.00	0.93
10	600048	保利地产	2,980,228.00	0.90
11	600004	白云机场	2,791,860.90	0.85
12	601888	中国国旅	2,717,489.00	0.82
13	600872	中炬高新	2,369,310.00	0.72
14	600276	恒瑞医药	2,159,716.00	0.65
15	600763	通策医疗	2,143,830.00	0.65
16	601916	浙商银行	2,076,173.32	0.63
17	003816	中国广核	2,002,522.74	0.61
18	603160	汇顶科技	1,965,154.00	0.60
19	600867	通化东宝	1,837,849.76	0.56
20	601088	中国神华	1,714,290.00	0.52

##### 1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	17,353,534.80	5.26
2	601166	兴业银行	9,635,934.00	2.92
3	600004	白云机场	5,386,734.00	1.63
4	000786	北新建材	5,348,183.00	1.62
5	600872	中炬高新	5,105,086.00	1.55

6	600309	万华化学	4,300,173.00	1.30
7	300015	爱尔眼科	4,282,153.90	1.30
8	000333	美的集团	2,208,672.00	0.67
9	600763	通策医疗	2,094,622.00	0.63
10	603160	汇顶科技	2,073,282.00	0.63
11	000538	云南白药	1,510,026.00	0.46
12	688036	传音控股	1,222,548.27	0.37
13	600867	通化东宝	1,221,364.56	0.37
14	003816	中国广核	1,199,101.96	0.36
15	688116	天奈科技	767,741.40	0.23
16	601916	浙商银行	637,979.98	0.19
17	688168	安博通	405,607.72	0.12
18	688101	三达膜	324,266.15	0.10
19	688098	申联生物	261,679.89	0.08
20	688089	嘉必优	260,162.86	0.08

### 1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	67,859,432.05
卖出股票收入（成交）总额	68,648,001.61

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,372,000.00	18.29
	其中：政策性金融债	30,225,000.00	9.16
4	企业债券	141,960,000.00	43.00
5	企业短期融资券	30,108,000.00	9.12
6	中期票据	15,111,000.00	4.58
7	可转债（可交换债）	30,390,364.26	9.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	277,941,364.26	84.20

**1.6 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**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	122338	13 金桥债	300,000	31,206,000.00	9.45
2	018007	国开 1801	300,000	30,225,000.00	9.16
3	136554	16 中金 01	300,000	30,147,000.00	9.13
4	011901431	19 南京地铁 SCP003	300,000	30,108,000.00	9.12
5	122437	15 远洋 01	200,000	20,182,000.00	6.11

**1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

**1.8 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贵金属投资明细**

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**1.9 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。

**1.10 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。

**1.11 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。

**1.12 投资组合报告附注****1.12.1 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没有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、处罚的情况。

**1.12.2 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。

**1.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	182,772.33
2	应收证券清算款	1,292,271.23
3	应收股利	-
4	应收利息	3,745,852.65
5	应收申购款	190,326.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,411,223.20

**1.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110053	苏银转债	5,869,500.00	1.78
2	128028	赣锋转债	2,230,265.96	0.68
3	127012	招路转债	802,130.00	0.24
4	113026	核能转债	335,358.00	0.10
5	123022	长信转债	197,119.00	0.06
6	128061	启明转债	164,745.00	0.05
7	113014	林洋转债	144,357.20	0.04
8	128064	司尔转债	144,244.10	0.04
9	110054	通威转债	139,338.30	0.04
10	113530	大丰转债	134,398.60	0.04
11	110055	伊力转债	91,104.00	0.03
12	127011	中鼎转 2	56,435.00	0.02

**1.12.5 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。

**投资组合报告（转型前）****1.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	82,517,198.62	12.10
	其中：股票	82,517,198.62	12.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	487,557,519.92	71.47
	其中：债券	487,557,519.92	71.47
	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	83,594,907.02	12.25
8	其他各项资产	28,514,588.35	4.18
9	合计	682,184,213.91	100.00

## 1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	326,576.25	0.06
C	制造业	27,146,500.47	4.80
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	5,487,000.00	0.97
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	44,780,000.00	7.91
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,777,121.90	0.84
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	82,517,198.62	14.58

### 1.2.2 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。

### 1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	300,000	25,950,000.00	4.59
2	601166	兴业银行	1,000,000	18,830,000.00	3.33
3	600309	万华化学	200,000	8,736,000.00	1.54
4	000786	北新建材	500,000	8,075,000.00	1.43
5	600872	中炬高新	160,000	6,356,800.00	1.12
6	600004	白云机场	300,000	5,487,000.00	0.97
7	601888	中国国旅	50,000	4,380,000.00	0.77
8	000538	云南白药	50,000	3,778,000.00	0.67
9	002127	南极电商	41,410	397,121.90	0.07
10	600968	海油发展	102,375	326,576.25	0.06
11	002960	青鸟消防	2,200	60,434.00	0.01
12	603983	丸美股份	1,392	58,046.40	0.01
13	603662	柯力传感	1,052	43,994.64	0.01
14	603115	海星股份	1,299	20,952.87	0.00
15	300787	海能实业	632	17,272.56	0.00

### 1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 1.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	27,230,888.00	1.90
2	002475	立讯精密	21,468,931.50	1.50
3	601088	中国神华	12,508,226.00	0.87
4	600004	白云机场	10,788,235.00	0.75
5	000786	北新建材	10,068,015.00	0.70
6	000538	云南白药	8,795,342.00	0.61
7	600872	中炬高新	5,122,524.00	0.36
8	688012	中微公司	691,888.50	0.05

9	688099	晶晨股份	600,484.50	0.04
10	688029	南微医学	554,291.60	0.04
11	688188	柏楚电子	538,147.26	0.04
12	688088	虹软科技	489,342.72	0.03
13	688005	容百科技	477,482.94	0.03
14	688020	方邦股份	411,804.84	0.03
15	688018	乐鑫科技	392,126.40	0.03
16	601233	桐昆股份	364,199.60	0.03
17	688011	新光光电	335,458.63	0.02
18	688321	微芯生物	272,291.04	0.02
19	600968	海油发展	208,845.00	0.01
20	002960	青鸟消防	38,148.00	0.00

#### 1.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	23,658,131.00	1.65
2	002475	立讯精密	22,949,027.20	1.60
3	600309	万华化学	18,868,135.43	1.31
4	601888	中国国旅	13,463,690.72	0.94
5	000651	格力电器	11,740,017.00	0.82
6	601088	中国神华	10,753,690.00	0.75
7	601166	兴业银行	9,054,821.00	0.63
8	600004	白云机场	9,046,302.40	0.63
9	000538	云南白药	3,745,960.00	0.26
10	688099	晶晨股份	2,517,548.79	0.18
11	688188	柏楚电子	1,946,056.00	0.14
12	688012	中微公司	1,833,111.00	0.13
13	688321	微芯生物	1,300,127.00	0.09
14	688029	南微医学	1,025,096.00	0.07
15	688088	虹软科技	772,285.00	0.05
16	688005	容百科技	763,956.83	0.05
17	688018	乐鑫科技	638,096.88	0.04
18	688020	方邦股份	635,646.45	0.04
19	688011	新光光电	520,959.76	0.04
20	601233	桐昆股份	259,992.20	0.02

#### 1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	101,552,411.83
卖出股票收入（成交）总额	135,892,013.81

注:本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列,不考虑相关交易费用。

### 1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,399,000.00	15.98
	其中:政策性金融债	30,267,000.00	5.35
4	企业债券	292,840,000.00	51.75
5	企业短期融资券	50,080,000.00	8.85
6	中期票据	10,143,000.00	1.79
7	可转债(可交换债)	44,095,519.92	7.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	487,557,519.92	86.17

### 1.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	011901431	19 南京地铁 SCP003	500,000	50,080,000.00	8.85
2	122338	13 金桥债	400,000	41,800,000.00	7.39
3	136643	16 华宇 02	400,000	40,000,000.00	7.07
4	018007	国开 1801	300,000	30,267,000.00	5.35
5	136554	16 中金 01	300,000	30,135,000.00	5.33

### 1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 1.8 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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**1.9 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。

**1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

**1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

**1.12 投资组合报告附注****1.12.1 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没有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、处罚的情况。

**1.12.2 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。

**1.12.3 期末其他各项资产构成**

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	41,164.23
2	应收证券清算款	21,194,139.93
3	应收股利	-
4	应收利息	7,278,987.75
5	应收申购款	296.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,514,588.35

**1.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132007	16 凤凰 EB	4,201,040.40	0.74
2	128028	赣锋转债	1,835,811.12	0.32

3	128047	光电转债	1,090,152.00	0.19
4	110049	海尔转债	686,561.40	0.12
5	132012	17 巨化 EB	379,890.00	0.07

### 1.12.5 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。

## 十二、基金的业绩

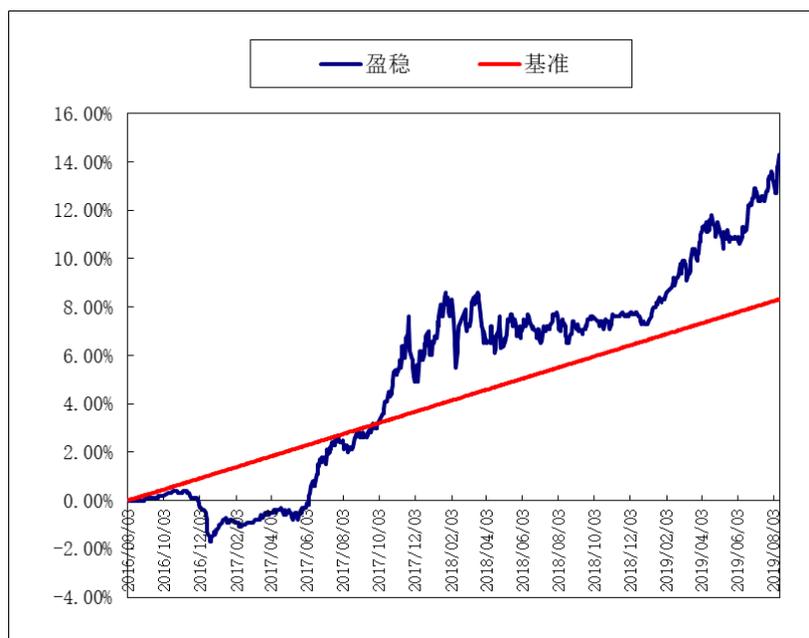
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

转型前：

(一) 本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

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)
2016年8月3日 (基金合同生效日) 至2016年12月 31日	-1.20%	0.08%	1.13%	0.01%	-2.33%	0.07%
2017年1月1日 至2017年12月 31日	7.29%	0.19%	2.75%	0.01%	4.54%	0.18%
2018年1月1日 至2018年12月 31日	1.23%	0.24%	2.75%	0.01%	-1.52%	0.23%
2019年1月1日 至2019年8月 12日	6.52%	0.21%	1.69%	0.01%	4.83%	0.20%
2016年8月3日 (基金合同生效日) 至2019年8月 12日	14.30%	0.20%	8.32%	0.01%	5.98%	0.19%

(二) 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图

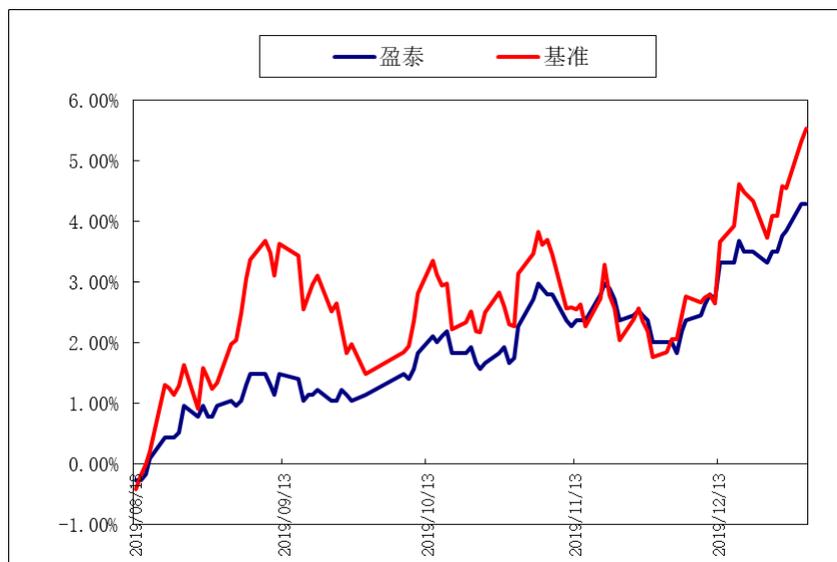


转型后：

(一) 本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

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)
2019年8月13日 (基金合同生效日) 至2019年12月31日	4.29%	0.20%	5.53%	0.39%	-1.24%	-0.19%

(二) 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图



### 十三、基金的费用与税收

#### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

##### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

上述“一、基金费用的种类”中第 3-9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用根据《汇添富盈稳保本混合型证券投资基金基金合同》的约定执行；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

（一）针对“重要提示”章节：增加了本次招募说明书更新的主要事项和更新截止时间。

（二）针对“基金管理人”章节：更新了基金管理人的相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2020 年 5 月 21 日