## 汇添富盈稳保本混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3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: 中国银行股份有限公司

报告送出日期: 2017年4月24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2017年4月20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2017年1月1日起至3月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	汇添富盈稳保本混合		
交易代码	002959		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016年8月3日		
报告期末基金份额总额	2, 848, 876, 575. 46 份		
投资目标	本基金主要通过投资组合保险技术来运作,在保证本金安全的前提下,力争在保本期内实现基金财产的程度增值。		
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合,利用组合保险技术,动态调整稳健资产与风险资产的投资比例,以确保基金在保本周期到期时,实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。稳健资产主要包括国债、央行票据、银行存款等品种。风险资产主要包括股票、权证、股指期货等品种。		
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率 (税后)		
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
基金保证人	北京中关村科技融资担保有限公司		

## § 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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1. 本期已实现收益	6, 370, 561. 42
2. 本期利润	17, 965, 733. 80
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0062
4. 期末基金资产净值	2, 833, 786, 564. 74
5. 期末基金份额净值	0. 995

- 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。

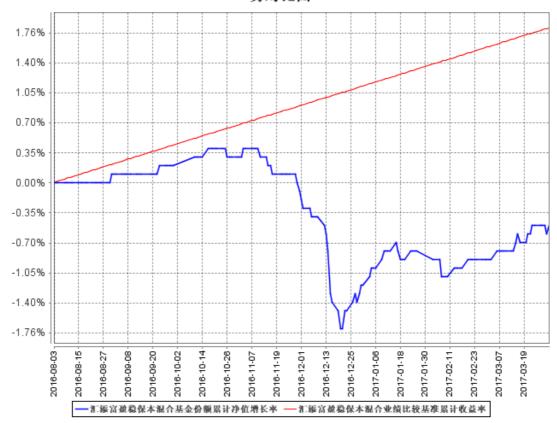
### 3.2 基金净值表现

### 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

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	0.71%	0.06%	0.68%	0.01%	0.03%	0. 05%

## 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

汇添富盈稳保本混合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



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2016年8月3日)起6个月,建仓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

<b>灶</b> 夕.	姓名  职务		任本基金的基金经理期限		说明	
X1.11	かガ	任职日期	离任日期	证券从业年限	Nr 42	
	汇添富多元				国籍:中国。学历:	
	收益、可转换	2016年8月3 日	<b>エ</b> 0 日 9		中国科技大学学	
	债券、实业债				士,清华大学 MBA。	
曾刚	债券、双利增			_	16年	业务资格:基金从
	强债券、汇添				业资格。从业经历:	
	富安鑫智选				2008年5月15日	
	混合、汇添富				至 2010 年 2 月 5	

第 4 页 共 13 页

2015年3月31日

稳健添利定 日任华富货币基金 的基金经理、2008 期开放债券 年 5 月 28 日至 基金、汇添富 6月红定期开 2011年11月1日 放债券基金、 任华富收益增强基 金的基金经理、 汇添富盈安 2010年9月8日至 保本混合基 金、汇添富盈 2011年11月1日 稳保本混合 任华富强化回报基 基金、汇添富 金的基金经理。 保鑫保本混 2011年11月加入 合基金、汇添 汇添富基金,现任 富长添利定 固定收益投资副总 监。2012年5月9 期开放债券 基金的基金 日至 2014 年 1 月 经理,固定收 21 日任汇添富理 益投资副总 财 30 天的基金经 监。 理,2012年6月12 日至 2014 年 1 月 21 日任汇添富理 财 60 天的基金经 理,2012年9月18 日至今任汇添富多 元收益的基金经 理, 2012年10月 18 日至 2014 年 9 月 17 日任汇添富 理财 28 天的基金 经理,2013年1月 24 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富 理财 21 天的基金 经理,2013年2月 7 日至今任汇添富 可转换债券的基金 经理,2013年5月 29 日至 2015 年 3 月 31 日任汇添富 理财7天的基金经 理,2013年6月14 日至今任汇添富实 业债的基金经理, 2013年9月12至

					<b>万定还今时人户心</b>
					任汇添富现金宝货
					币的基金经理, 2013年12月3日
					至今任汇添富双利
					增强债券的基金经
					理, 2015 年 11 月
					26 日至今任汇添
					富安鑫智选混合的
					基金经理,2016年
					2月17日至今任汇
					添富6月红定开债
					的基金经理,2016
					年3月16日至今任
					汇添富稳健添利定
					开债的基金经理,
					2016年4月19日
					至今任汇添富盈安
					保本混合的基金经
					理,2016年8月3
					日至今任汇添富盈
					稳保本混合的基金
					经理,2016年9月
					29 日至今任汇添
					富保鑫保本混合的
					基金经理,2016年
					12月6日至今任汇
					添富长添利定开债
					的基金经理。
					国籍:中国,学历:
	汇添富可转				厦门大学金融工程
	换债券基金、				硕士。2011 年加入
	汇添富盈安 保本混合基				汇添富基金管理股
					份有限公司任固定
	金、汇添富盈				收益分析师。2015
	稳保本混合				年7月17日至今任
吴江宏	基金、汇添富	2016年8月3	_	6年	汇添富可转换债券
	保鑫保本混	日			基金的基金经理,
	合基金、汇添				2016年4月19日
	富鑫利债券				至今任汇添富盈安
	基金、汇添富				保本混合基金的基
	绝对收益定				金经理,2016年8 月3日至今任汇添
	开混合基金 的基金经理。				日 3 日 至 今 任 仁 浴 富 盈 稳 保 本 混 合 基
	可至並红廷。				金的基金经理,
					亚 门 至 立 红 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。

- 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 4 次,由于组合投资策略导致,并经过公司 内部风控审核。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

一季度经济延续 2016 年四季度的回升态势,企业盈利、民间投资和信贷融资需求等多项指标在继续改善,特别是三四线城市地产销售和投资明显超预期。一季度工业品价格指数受供给侧改革推动继续大幅走高,但消费物价指数受食品价格影响,传导效果低于预期,通胀压力有所缓解。一季度货币政策方面,在金融去杠杆大环境下,叠加美联储加息影响,央行公开市场持续回笼资金、两次上调政策利率,同时在关键时点向市场投入流动性,表明央行在有意将流动性保持相对紧平衡的状态。一季度债券市场延续去年四季度的调整行情,随着经济回升、金融去杠杆和公开市场利率上调,债券收益率整体明显上行,各类债券收益率普遍上行 30-50BP 不等,收益率曲线明显平坦化。一季度蓝筹股在经济回升预期带动下小幅上涨,中小盘走势与蓝筹股出现分化。

一季度证监会出台《关于避险策略基金的指导意见》后,本基金严格按照规定对组合进行了 调仓,减持债券类风险资产并增持稳健资产,调仓后各类指标均已符合新规规定。本组合利用资 金紧张时点适度提高了组合杠杆,,相对去年四季度组合杠杆有所抬高, 久期有所缩短。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内本组合净值收益率为 0.71%。

### 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	104, 004, 811. 28	2.85
	其中: 股票	104, 004, 811. 28	2.85
2	基金投资	1	
3	固定收益投资	2, 692, 690, 001. 20	73. 76
	其中:债券	2, 668, 030, 001. 20	73. 08
	资产支持证券	24, 660, 000. 00	0. 68
4	贵金属投资	I	
5	金融衍生品投资	I	1
6	买入返售金融资产	49, 500, 000. 00	1.36
	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	724, 210, 230. 58	19.84
8	其他资产	80, 409, 713. 25	2. 20
9	合计	3, 650, 814, 756. 31	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	-	_
В	采矿业	-	_
С	制造业	76, 562, 699. 53	2.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	-	-
Е	建筑业	-	_
F	批发和零售业	74, 088. 00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	-	_
Ι	信息传输、软件和信息技术服务 业	-	-
J	金融业	24, 735, 000. 00	0.87
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	-	-

第9页共13页

0	居民服务、修理和其他服务业	Т	-
P	教育	2, 633, 023. 75	0.09
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1	1
	合计	104, 004, 811. 28	3. 67

## 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	000651	格力电器	1, 000, 000	31, 700, 000. 00	1.12
2	601318	中国平安	500, 000	18, 505, 000. 00	0.65
3	002035	华帝股份	499, 979	16, 689, 299. 02	0. 59
4	000921	海信科龙	699, 942	9, 946, 175. 82	0.35
5	600519	贵州茅台	20, 000	7, 727, 200. 00	0. 27
6	601328	交通银行	1, 000, 000	6, 230, 000. 00	0. 22
7	600660	福耀玻璃	200, 000	4, 522, 000. 00	0. 16
8	300003	乐普医疗	198, 854	3, 446, 139. 82	0.12
9	600661	新南洋	99, 925	2, 633, 023. 75	0.09
10	002508	老板电器	50, 000	2, 480, 000. 00	0.09

## 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	158, 915, 000. 00	5. 61
2	央行票据	_	1
3	金融债券	27, 660, 000. 00	0. 98
	其中: 政策性金融债	27, 660, 000. 00	0. 98
4	企业债券	1, 296, 281, 880. 00	45. 74
5	企业短期融资券	289, 793, 000. 00	10. 23
6	中期票据	213, 339, 000. 00	7. 53
7	可转债(可交换债)	18, 414, 121. 20	0.65
8	同业存单	663, 627, 000. 00	23. 42
9	其他	_	_
10	合计	2, 668, 030, 001. 20	94. 15

### 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	020161	17 贴债 05	1, 500, 000	148, 980, 000. 00	5. 26
2	111794663	17 汉口银 行 CD036	1, 300, 000	127, 062, 000. 00	4. 48
3	111708029	17 中信银 行 CD029	1, 000, 000	98, 900, 000. 00	3. 49
4	111717075	17 光大银 行 CD075	1, 000, 000	97, 840, 000. 00	3. 45
5	111697407	16 天津银 行 CD032	1, 000, 000	97, 470, 000. 00	3. 44

# 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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比 例(%)
1	1689247	16 上和 1A2	250, 000	24, 660, 000. 00	0.87

### 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投资。

### 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

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。

### 5.11.2

### 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	200, 049. 12
2	应收证券清算款	45, 844, 183. 14
3	应收股利	-
4	应收利息	34, 365, 031. 53
5	应收申购款	449. 46
6	其他应收款	_
7	待摊费用	-
8	其他	_
9	合计	80, 409, 713. 25

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末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

注: 本基金本报告期末前十名股票未有存在流通受限的情况。

## §6 开放式基金份额变动

单位: 份

报告期期初基金份额总额	2, 928, 838, 926. 28
报告期期间基金总申购份额	1, 396, 115. 96
减:报告期期间基金总赎回份额	81, 358, 466. 78
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	2, 848, 876, 575. 46

注: 总申购份额含转换入份额, 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%的情况注: 无。

\_

### § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予汇添富盈稳保本混合型证券投资基金注册的文件;
- 2、《汇添富盈稳保本混合型证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富盈稳保本混合型证券投资基金托管协议》;
- 4、法律意见书;
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照;
- 7、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 21 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 2017年4月24日