

汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金

2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 28 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 26 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 2020 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇添富盈鑫混合
基金主代码	002420
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 3 月 19 日
报告期末基金份额总额	166,751,607.14 份
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。
投资策略	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。
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%
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。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人	中国工商银行股份有限公司
-------	--------------

§ 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（2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	25,605,698.61
2. 本期利润	26,544,140.62
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1531
4. 期末基金资产净值	277,395,540.84
5. 期末基金份额净值	1.664

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。

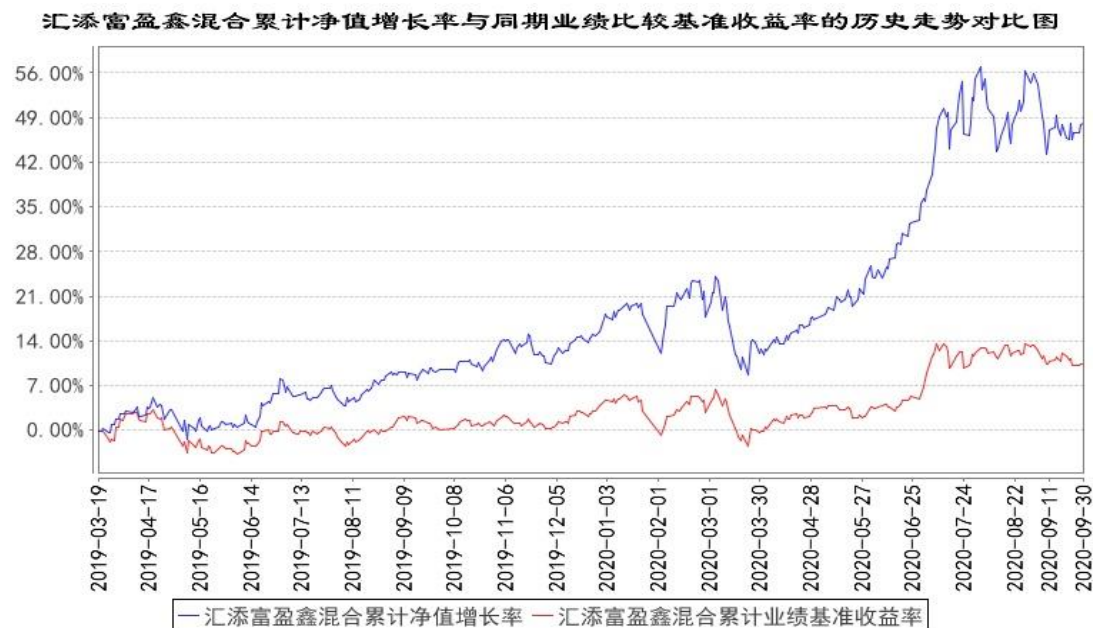
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	9.33%	1.66%	4.42%	0.79%	4.91%	0.87%
过去六个月	31.54%	1.32%	10.47%	0.65%	21.07%	0.67%
过去一年	35.39%	1.27%	10.31%	0.68%	25.08%	0.59%
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同 生效日起至 今	48.17%	1.11%	10.28%	0.66%	37.89%	0.45%

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



注：本基金建仓期为自本《基金合同》生效之日（2019 年 3 月 19 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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		
赵鹏程	本基金的基金经理	2020 年 6 月 10 日	—	9 年	国籍：中国，学历：浙江大学高分子化学与物理硕士。曾任天相投资股份有限公司研究员、信诚基金管理有限公司研究员。2011 年 8 月加入汇添富基金管理有限公司任高级行业分析师。2016 年 7 月 27 日至 2019 年 1 月 19 日任汇添富沪港深新价值股票基金的基金经理，2018 年 2 月 13 日至今任添富行业整合混合基金的基金经理，2019 年 1 月 18 日至 2020 年 5 月 20 日任汇添富环保行业股票基金的基金经理，2020 年 6 月 10 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、汇添富盈鑫混合的基金经理。

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“离任日期”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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作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。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、营运、风险管理以及合规稽核等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风控管控，确保公平交易制度的执行和实现。

对于同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3 日内和 5 日内）同买或者同卖同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。根据 95%置信区间下平均价差率的 T 检验显著程度、同向交易占优比等方面进行综合分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。本报告期内，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金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 1 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度中国经济延续了二季度的复苏趋势。截至 9 月综合 PMI 指数已经连续 7 个月保持在 50 以上的扩张区间；工业增加值同比增速自 4 月份转正后逐月加速，且 1-8 月累计值已经同比转正；地产销售和投资均在三季度均平稳增长；汽车、家电等耐用消费品销量同比、环比均呈月度改善趋势；三季度中国进出口贸易恢复明显，连续三个月出口金额保持在 8-9% 的同比增幅。

二级市场方面 A 股整体震荡上行，同时结构分化。从指数看，三季度上证指数涨 7.82%，深证成指涨 7.63%，沪深 300 涨 10.17%，中小板指涨 8.19%，创业板指涨 5.60%。三季度大部分申万一级行业指数录得上涨，仅通信、商贸、计算机三个行业指数下跌，涨幅居前的行业主要包括休闲服务、国防军工、电气设备及汽车，涨幅均在 20% 以上；另外食品饮料、化工、建筑建材、非银金融、机械设备、轻工等行业指数季度涨幅也达 10% 以上。整体而言行业表现与阶段性景气趋势高度相关。

本基金长期选择配置消费升级、科技创新等投资主题下具有核心竞争优势的资产。三季度本基金主要调整了消费、医药股的持仓结构，增加了化工、新能源及消费电子领域相关资产。本基金在三季度收益率跑输沪深 300，跑赢比较基准。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.664 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.33%，业绩比较基准收益率为 4.42%。

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	235,650,349.65	84.72
	其中：股票	235,650,349.65	84.72
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	-	-
	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	42,390,651.26	15.24
8	其他资产	113,778.83	0.04
9	合计	278,154,779.74	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	-	-
C	制造业	112,911,241.11	40.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	25,649.49	0.01
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	31,007,916.89	11.18
J	金融业	2,399,000.00	0.86
K	房地产业	12,250,865.00	4.42
L	租赁和商务服务业	44,768,308.00	16.14
M	科学研究和技术服务业	1,031,624.28	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	148,986.16	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,610,400.00	0.94
Q	卫生和社会工作	3,579,800.00	1.29
R	文化、体育和娱乐业	24,903,529.60	8.98
S	综合	-	-
	合计	235,650,349.65	84.95

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投资股票投资组合。

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	601888	中国中免	115,000	25,638,100.00	9.24

2	300760	迈瑞医疗	50,000	17,400,000.00	6.27
3	300413	芒果超媒	200,000	13,480,000.00	4.86
4	002507	涪陵榨菜	279,300	13,143,858.00	4.74
5	300144	宋城演艺	626,290	11,423,529.60	4.12
6	002127	南极电商	640,800	11,060,208.00	3.99
7	600570	恒生电子	106,230	10,473,215.70	3.78
8	001914	招商积余	361,900	9,536,065.00	3.44
9	603517	绝味食品	110,000	9,022,200.00	3.25
10	002624	完美世界	256,350	8,536,455.00	3.08

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

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：报告期末本基金无股指期货持仓。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：报告期末本基金无国债期货持仓。

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 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	50,768.12
2	应收证券清算款	57,967.39
3	应收股利	—
4	应收利息	3,097.65
5	应收申购款	1,945.67
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	113,778.83

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：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不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	190,672,185.45
报告期期间基金总申购份额	3,797,711.22
减：报告期期间基金总赎回份额	27,718,289.53
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	166,751,607.14

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：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

注：无。

§ 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盈鑫保本混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 5、《汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 8、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 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

2020 年 10 月 28 日