汇添富理财60天债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2018年10月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	汇添富理财60天债券	
交易代码	470060	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年6月12日	
报告期末基金份额总额	5,661,191,007.68份	
投资目标	在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，努力追求绝对收益，为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。	
投资策略	将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在180天以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率	
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金，混合型基金，高于货币市场型证券投资基金。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富理财60天债券A	汇添富理财60天债券B	汇添富理财60天债券E
下属分级基金的交易代码	470060	471060	005503
报告期末下属分级基金的份额总额	290,611,628.79份	3,001,605,471.72份	2,368,973,907.17份

注：本基金自2017年12月21日起增设E类份额，份额申购首次确认日为2017年12月22日。

§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(2018年7月1日－2018年9月30日)		
	汇添富理财60天债券A	汇添富理财60天债券B	汇添富理财60天债券E
1.本期已实现收益	2,357,541.18	32,120,456.08	19,196,800.80
2.本期利润	2,357,541.18	32,120,456.08	19,196,800.80
3.期末基金资产净值	290,611,628.79	3,001,605,471.72	2,368,973,907.17

注：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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富理财60天债券A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9946%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.6543%	0.0008%

注：本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

汇添富理财60天债券B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0678%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.7275%	0.0008%

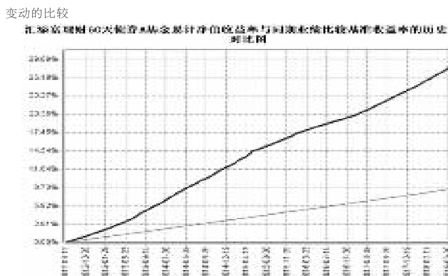
注：本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

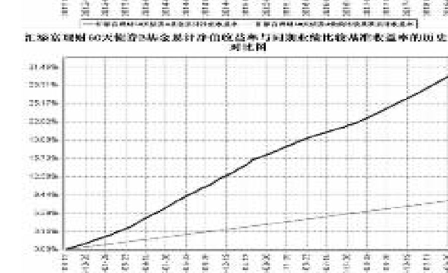
汇添富理财60天债券E

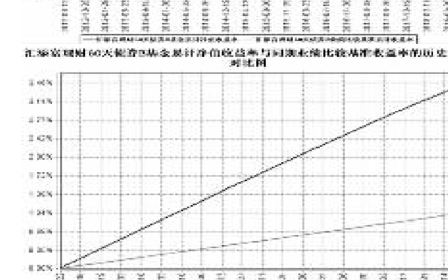
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0325%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.6922%	0.0008%

注：本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较







注：1.本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2012年6月12日)起五日，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

2.本基金自2017年12月21日起增设E类份额，份额申购首次确认日为2017年12月22日。

§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		
徐寅喆	汇添富和聚宝货币基金、汇添富理财7天债券基金、汇添富货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金的基金经理。	2018年5月4日	-	10年	国籍：中国。学历：复旦大学法学学士。曾任长江养老保险股份有限公司债券交易员。2012年5月加入汇添富基金管理股份有限公司任债券交易员、固定收益基金经理助理。2014年8月27日至今任汇添富理财7天债券型证券投资基金的基金经理，2014年8月27日至2018年5月4日任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，2014年11月26日至今任汇添富和聚宝货币市场基金经理，2014年12月23日至2018年5月4日任汇添富收益快钱货币基金基金经理，2016年6月7日至2018年5月4日任汇添富全额宝货币基金的基金经理，2018年5月4日至今任汇添富货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金的基金经理。

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3次，由于组合投资策略导致。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

三季度宏观经济环境复杂多变。国际方面，中美贸易纠纷升级，美国自9月24日起对2000亿美元商品加征关税税率为10%，并且明年可能上调至25%。9月27日美联储年内第三次加息，并对劳动力市场的表现和控制通胀的预期信心充足。在此情形下，美债10Y收益率突破了3.2%，创下2011年以来的高位。国内方面，"稳增长"力度不断发力，有利于对短期经济预期的修复。三季度国务院相关部委政策暖风频出，国家发改委提出"加大基建补短板力度稳定有效投资"，国常会上总理听取企业减税降费后续政策安排和要求加大对中小企业的融资支持。此外，地方政府加速发行专项债，发行规模已过万亿。从数据方面看，社会融资此前快速下行的态势得到扭转，但社会融资结构仍需关注。具体体现在非标融资持续性的萎缩，而企业新增贷款主要来自票据融资，说明当前宽货币到宽信用的传导环节仍需继续疏通。另外值得关注的是，三季度受台风、雨水天气和肉猪瘟疫的影响，蔬菜和猪肉价格出现一定上涨，导致短期内通胀预期有所升温，后续原油价格上涨将对通胀构成一定压力。

三季度货币政策延续之前的稳健基调，市场流动性偏向充裕。债券方面，受资金面宽松、地方专项债密集发行和稳增长政策发力等影响，长短期债券收益率出现显著分化。短端收益率三季度出现了大幅下行，以3M国股行存单为代表的短期收益率从季初3.7%回落至2.75%。长端债券收益率则窄幅震荡，10年期国开收益率在4.05%至4.25%之间波动。本基金考虑组合规模的波动情况和对后续市场流动性的分析后采取较为进取的投资操作。整体思路是拉长组合剩余天数和提升杠杆水平，对组合债券仓位和债券结构进行灵活调整。在季初和季末加大了资产配置力度，尤其是存单的配置比例。银行选择方面，按照公司内部额度管理制度，降低单家银行的集中度，控制信用风险。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富理财60天债券A的基金份额净值收益率为0.9946%，本报告期汇添富理财60天债券B的基金份额净值收益率为1.0678%，本报告期汇添富理财60天债券E的基金份额净值收益率为1.0325%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

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	固定收益投资	4,294,320,048.79	66.04
	其中：债券	4,294,320,048.79	66.04
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,173,509,031.63	33.42
4	其他资产	35,116,245.37	0.54
5	合计	6,502,945,325.79	100.00

5.2报告期债券回购融资情况

序号	项目		占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		10.59
	其中：买断式回购融资		-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	819,912,850.12	14.48
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注：本基金合同约定："本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%"，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.3基金投资组合平均剩余期限

5.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	136
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	165
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	128

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：本基金合同约定："本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过180天"，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	1.83	14.48
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
2	30天(含)-60天	7.40	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
3	60天(含)-90天	30.87	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
4	90天(含)-120天	0.87	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
5	120天(含)-397天(含)	73.27	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
合计		114.25	14.48

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本报告期内本货币基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	329,817,610.00	5.83
	其中：政策性金融债	329,817,610.00	5.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,964,502,438.79	70.03
8	其他	-	-
9	合计	4,294,320,048.79	75.86
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180404	18农发04	1,500,000	150,114,102.66	2.65
2	111898775	18哈尔滨银行CD101	1,500,000	147,000,533.83	2.60
3	111881852	18贵阳银行CD127	1,400,000	138,372,032.41	2.44
4	111881884	18厦门银行CD098	1,000,000	99,729,798.56	1.76
5	111884103	18齐鲁银行CD091	1,000,000	99,493,960.40	1.76
6	111821205	18渤海银行CD205	1,000,000	99,184,752.45	1.75
7	111803120	18农业银行CD120	1,000,000	99,135,812.94	1.75
8	111808170	18中信银行CD170	1,000,000	99,041,466.81	1.75
9	111715477	17民生银行CD477	1,000,000	99,038,707.83	1.75
10	111893601	18盛京银行CD099	1,000,000	99,023,167.66	1.75

5.7"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	43
报告期内偏离度的最高值	0.4578%
报告期内偏离度的最低值	0.1988%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2784%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本报告期内，本基金未发生负偏离度的绝对值达到0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：本报告期内，本基金未发生正偏离度的绝对值达到0.5%情况。

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。

5.9投资组合报告附注

5.9.1

本基金估值采用摊余成本法计价，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.9.2

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、处罚的情形。

5.9.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	35,116,245.37
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	35,116,245.37

§6开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富理财60天债券A	汇添富理财60天债券B	汇添富理财60天债券E
报告期期初基金份额总额	222,391,242.06	2,972,827,350.35	1,390,978,329.41
报告期期间基金总申购份额	145,019,273.13	98,779,121.37	1,966,480,100.32
报告期期间基金总赎回份额	76,798,886.40	70,001,000.00	988,484,522.56
报告期期末基金份额总额	290,611,628.79	3,001,605,471.72	2,368,973,907.17

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交易明细

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、中国证监会批准汇添富理财60天债券型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富理财60天债券型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富理财60天债券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、报告期内汇添富理财60天债券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

2018年10月26日

汇添富理财7天债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018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：2018年10月26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2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	汇添富理财7天债券	
交易代码	471007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年5月29日	
报告期末基金份额总额	15,957,866,240.81份	
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，努力追求绝对收益，为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。	
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在127天内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率	
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金，混合型基金，高于货币市场型证券投资基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B
下属分级基金的交易代码	471007	472007
报告期末下属分级基金的份额总额	206,035,514.59份	15,751,830,726.22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(2018年7月1日－2018年9月30日)	
	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B
1.本期已实现收益	1,670,204.82	157,562,019.73
2.本期利润	1,670,204.82	157,562,019.73
3.期末基金资产净值	206,035,514.59	15,751,830,726.22

注：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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富理财7天债券A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8980%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.5577%	0.0010%

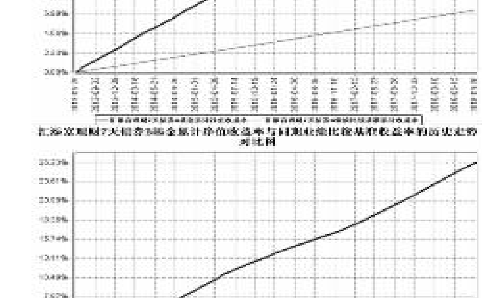
注：1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。2、本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

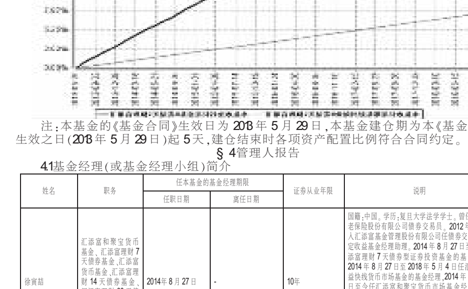
汇添富理财7天债券B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0098%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.6695%	0.0010%

注：1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。2、本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：本基金的《基金合同》生效日为2013年5月29日，本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年5月29日)起5天，建仓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		
徐寅喆	汇添富和聚宝货币基金、汇添富理财7天债券基金、汇添富货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金的基金经理。	2014年8月27日	-	10年	国籍：中国。学历：复旦大学法学学士。曾任长江养老保险股份有限公司债券交易员。2012年5月加入汇添富基金管理股份有限公司任债券交易员、固定收益基金经理助理。2014年8月27日至今任汇添富理财7天债券型证券投资基金的基金经理，2014年8月27日至2018年5月4日任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，2014年11月26日至今任汇添富和聚宝货币市场基金经理，2014年12月23日至2018年5月4日任汇添富收益快钱货币基金基金经理，2016年6月7日至2018年5月4日任汇添富全额宝货币基金的基金经理，2018年5月4日至今任汇添富货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金的基金经理。

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3次，由于组合投资策略导致。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

三季度宏观经济环境复杂多变。国际方面，中美贸易纠纷升级，美国自9月24日起对2000亿美元商品加征关税税率为10%，并且明年可能上调至25%。9月27日美联储年内第三次加息，并对劳动力市场的表现和控制通胀的预期信心充足。在此情形下，美债10Y收益率突破了3.2%，创下2011年以来的高位。国内方面，"稳增长"力度不断发力，有利于对短期经济预期的修复。三季度国务院相关部委政策暖风频出，国家发改委提出"加大基建补短板力度稳定有效投资"，国常会上总理听取企业减税降费后续政策安排和要求加大对中小企业的融资支持。此外，地方政府加速发行专项债，发行规模已过万亿。从数据方面看，社会融资此前快速下行的态势得到扭转，但社会融资结构仍需关注。具体体现在非标融资持续性的萎缩，而企业新增贷款主要来自票据融资，说明当前宽货币到宽信用的传导环节仍需继续疏通。另外值得关注的是，三季度受台风、雨水天气和肉猪瘟疫的影响，蔬菜和猪肉价格出现一定上涨，导致短期内通胀预期有所升温，后续原油价格上涨将对通胀构成一定压力。

三季度货币政策延续之前的稳健基调，市场流动性偏向充裕。债券方面，受资金面宽松、地方专项债密集发行和稳增长政策发力等影响，长短期债券收益率出现显著分化。短端收益率三季度出现了大幅下行，以3M国股行存单为代表的短期收益率从季初3.7%回落至2.75%。长端债券收益率则窄幅震荡，10年期国开收益率在4.05%至4.25%之间波动。本基金考虑组合规模的变动情况和对后续市场流动性的分析后采取较为进取的投资操作。整体思路是拉长组合剩余天数和提升杠杆水平，对组合债券仓位和债券结构进行灵活调整。在季初和季末加大了资产配置力度。银行选择方面，按照公司内部额度管理制度，降低单家银行的集中度，控制信用风险。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富理财7天债券A的基金份额净值收益率为0.8980%，本报告期汇添富理财7天债券B的基金份额净值收益率为1.0098%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

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	固定收益投资	11,982,852,624.73	68.18
	其中：债券	11,982,852,624.73	68.18
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,505,813,610.19	31.33
4	其他资产	86,536,277.06	0.49
5	合计	17,575,202,511.98	100.00

5.2报告期债券回购融资情况

序号	项目		占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		11.67
	其中：买断式回购融资		-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,604,890,712.66	10.06
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注：本基金合同约定："本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%"，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.3基金投资组合平均剩余期限

5.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	118
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	123
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	82

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：本基金合同约定："本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过127天"，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	6.68	10.06
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
2	30天(含)-60天	23.67	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
3	60天(含)-90天	40.05	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
4	90天(含)-120天	4.51	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
5	120天(含)-397天(含)	34.68	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
	合计	109.59	10.06

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本报告期内本货币基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	280,523,641.06	1.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	629,564,233.79	3.95
	其中：政策性金融债	629,564,233.79	3.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	89,982,640.52	0.56
6	中期票据	-	-
7	同业存单	10,982,782,109.36	68.82
8	其他	-	-
9	合计	11,982,852,624.73	75.09
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111810403	18兴业银行CD403	5,000,000	497,834,782.62	3.12
2	111803120	18农业银行CD120	5,000,000	495,678,723.64	3.11
3	170211	17国开11	4,600,000	459,891,879.59	2.88
4	111821217	18渤海银行CD217	4,500,000	440,421,801.33	2.76
5	111883132	18重庆农村商行CD077	4,000,000	398,484,980.82	2.50
6	111820165	18广发银行CD165	4,000,000	398,199,828.70	2.50
7	111897476	18青岛银行CD038	3,000,000	298,759,636.97	1.87
8	111810223	18兴业银行CD223	3,000,000	295,200,484.77	1.85
9	111899362	18贵阳银行CD102	3,000,000	293,736,232.21	1.84
10	111817182	18光大银行CD182	3,000,000	291,578,976.90	1.83

5.7"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	1
报告期内偏离度的最高值	0.2515%
报告期内偏离度的最低值	0.0535%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1412%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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。

5.9投资组合报告附注

5.9.1

本基金估值采用摊余成本法计价，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.9.2

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、处罚的情形。

5.9.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	86,536,277.06
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	86,536,277.06

§6开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B
报告期期初基金份额总额	185,340,625.66	15,580,382,764.22
报告期期间基金总申购份额	151,542,744.28	202,744,667.31
报告期期间基金总赎回份额	130,847,855.35	31,296,705.31
报告期期末基金份额总额	206,035,514.59	15,751,830,726.22

注：总申购份额含红利再投份额

§7基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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	2018年7月1日至2018年9月30日	15,545,528,761.00	157,669,957.07	0.00	15,703,198,718.07	98.40%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

1、持有人大会投票权集中的风险

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。

2、巨额赎回的风险

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，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

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长期低于5000万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

§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理财7天债券型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富理财7天债券型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富理财7天债券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、报告期内汇添富理财7天债券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

2018年10月26日

汇添富货币市场基金

2018年第三季度报告

2018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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2018年10月26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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	汇添富货币	
交易代码	519518	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年3月23日	
报告期末基金份额总额	25,936,390,910.97份	
投资目标	力求在本金稳妥和基金资产高流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。	
业绩比较基准	税后活期存款利率(即活期存款利率×(1-利息税率))。	
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	下属分级基金的交易代码	报告期末下属分级基金的份额总额
汇添富货币A	519518	262,729,133.23份
汇添富货币B	519517	18,242,563,355.44份
汇添富货币C	000642	4,123,451,664.56份
汇添富货币D	000650	3,307,646,757.74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		1.本期已实现收益	2.本期利润	3.期末基金资产净值
报告期(2018年7月1日－2018年9月30日)	汇添富货币A	2,119,269.67	2,119,269.67	262,729,133.23
	汇添富货币B	138,627,747.69	138,627,747.69	18,242,563,355.44
	汇添富货币C	47,830,312.77	47,830,312.77	4,123,451,664.56
	汇添富货币D	31,791,673.23	31,791,673.23	3,307,646,757.74

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。2.本基金自2014年6月6日起增加C类和D类分级基金，该类分级基金只收取销售服务费，不收取申购费和赎回费。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8605%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.7723%	0.0008%

汇添富货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9215%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.8333%	0.0008%

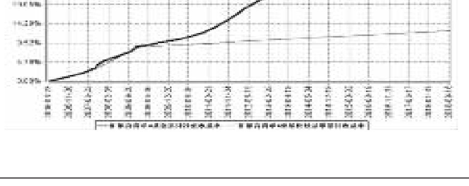
汇添富货币C

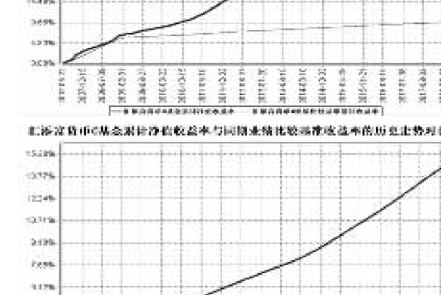
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8605%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.7723%	0.0008%

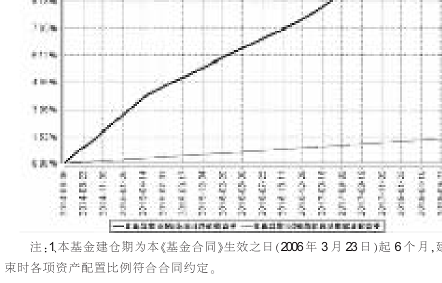
汇添富货币D

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8605%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.7723%	0.0008%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较







注：1.本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2006年3月23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。

2.本基金从本《基金合同》生效之日起至2009年2月15日采用的业绩比较基准为同期税后一年定期存款利率。从2009年2月16日起，本基金业绩比较基准为同期税后活期存款利率。

§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		
蒋文玲	汇添富货币基金、现金宝货币基金、添富通货币基金、实业债债券基金、优选回报混合基金、汇添富鑫益定开债基金、添富年年益定开混合、添富鑫汇定开债券基金、汇添富睿丰混合基金、汇添富新睿精选混合基金的基金经理，汇添富多元收益债券基金的基金经理助理。	2016年6月7日	-	12年	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任汇添富基金债券交易员、债券风控研究员。2012年11月30日至2014年1月7日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014年1月加入汇添富基金，历任金融工程部高级经理、固定收益基金经理助理。2014年4月8日至今任汇添富多元收益债券基金的基金经理助理，2015年3月10日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富优选回报混合基金(原理财21天债券基金)的基金经理，2015年3月10日至2018年5月4日任汇添富理财14天债券基金的基金经理，2016年6月7日至今任汇添富货币基金、添富通货币基金、实业债债券基金的基金经理，2016年6月7日至2018年5月4日任理财30天债券基金、理财60天债券基金的基金经理，2017年4月20日至今任汇添富鑫益定开债基金的基金经理，2017年5月15日至今任添富年年益定开混合基金的基金经理，2017年6月23日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理，2018年8月2日至今任汇添富睿丰混合基金、汇添富新睿精选混合基金的基金经理。
徐寅喆	汇添富和聚宝货币基金、汇添富理财7天债券基金、汇添富货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金的基金经理。	2018年5月4日	-	10年	国籍：中国。学历：复旦大学法学学士。曾任长江养老保险股份有限公司债券交易员。2012年5月加入汇添富基金管理股份有限公司任债券交易员、固定收益基金经理助理。2014年8月27日至今任汇添富理财7天债券型证券投资基金的基金经理，2014年8月27日至2018年5月4日任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，2014年11月26日至今任汇添富和聚宝货币市场基金经理，2014年12月23日至2018年5月4日任汇添富收益快钱货币基金基金经理，2016年6月7日至2018年5月4日任汇添富全额宝货币基金的基金经理，2018年5月4日至今任汇添富货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金的基金经理。

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3次，由于组合投资策略导致。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

三季度宏观经济环境复杂多变。国际方面，中美贸易纠纷升级，美国自9月24日起对2000亿美元商品加征关税税率为10%，并且明年可能上调至25%。9月27日美联储年内第三次加息，并对劳动力市场的表现和控制通胀的预期信心充足。在此情形下，美债10Y收益率突破了3.2%，创下2011年以来的高位。国内方面，"稳增长"力度不断发力，有利于对短期经济预期的修复。三季度国务院相关部委政策暖风频出，国家发改委提出"加大基建补短板力度稳定有效投资"，国常会上总理听取企业减税降费后续政策安排和要求加大对中小企业的融资支持。此外，地方政府加速发行专项债，发行规模已过万亿。从数据方面看，社会融资此前快速下行的态势得到扭转，但社会融资结构仍需关注。具体体现在非标融资持续性的萎缩，而企业新增贷款主要来自票据融资，说明当前宽货币到宽信用的传导环节仍需继续疏通。另外值得关注的是，三季度受台风、雨水天气和肉猪瘟疫的影响，蔬菜和猪肉价格出现一定上涨，导致短期内通胀预期有所升温，后续原油价格上涨将对通胀构成一定压力。

三季度货币政策延续之前的稳健基调，市场流动性偏向充裕。债券方面，受资金面宽松、地方专项债密集发行和稳增长政策发力等影响，长短期债券收益率出现显著分化。短端收益率三季度出现了大幅下行，以3M国股行存单为代表的短期收益率从季初3.7%回落至2.75%。长端债券收益率则窄幅震荡，10年期国开收益率在4.05%至4.25%之间波动。本基金考虑组合规模的波动情况和对后续市场流动性的分析后采取较为进取的投资操作。整体思路是拉长组合剩余天数和提升杠杆水平，对组合债券仓位和债券结构进行灵活调整。在季初和季末加大了资产配置力度，8月初适度进行了减仓。另外，考虑利差水平，增加了短期融资券的配置。债券选择方面，以AAA评级为主，控制信用风险。存款合作银行方面，按照公司内部额度管理制度，降低单家存款银行的集中度。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富货币A的基金份额净值收益率为0.8605%，本报告期汇添富货币B的基金份额净值收益率为0.9215%，本报告期汇添富货币C的基金份额净值收益率为0.8605%，本报告期汇添富货币D的基金份额净值收益率为0.8605%，同期业绩比较基准收益率为0.0882%。

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	固定收益投资	9,348,771,536.71	34.81
	其中：债券	9,348,771,536.71	34.81
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,932,701,834.05	14.64
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	13,408,223,980.77	49.93
4	其他资产	165,180,629.63	0.62
5	合计	26,854,877,981.16	100.00

5.2报告期债券回购融资情况

序号	项目		占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		0.87
	其中：买断式回购融资		-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	899,865,130.20	3.47
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3基金投资组合平均剩余期限

5.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	69

5.3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	28.33	3.51
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.15	-
2	30天(含)-60天	17.38	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
3	60天(含)-90天	29.68	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
4	90天(含)-120天	2.79	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
5	120天(含)-397天(含)	24.72	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
合计		102.90	3.51

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：报告期内投资组合平均剩余存续期无超过240天情况。

5.5报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,484,308,345.11	5.72
	其中：政策性金融债	1,484,308,345.11	5.72
4	企业债券	719,508,917.97	2.77
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	7,144,954,273.63	27.55
8	其他	-	-
9	合计	9,348,771,536.71	36.04
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	39,275,458.65	0.15

5.6报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180404	18农发04	5,350,000	535,688,832.33	2.07
2	111885406	18广州农村商业银行CD070	4,000,000	399,459,290.40	1.54
3	111816305	18上海银行CD305	3,000,000	299,449,599.58	1.15
4	111805193	18建设银行CD193	3,000,000	298,533,929.08	1.15
5	111815423	18民生银行CD423	3,000,000	298,510,715.97	1.15
6	111895531	18重庆银行CD070	2,500,000	249,683,225.18	0.96
7	180201	18国开01	2,300,000	230,121,480.00	0.89
8	111805209	18建设银行CD209	2,200,000	214,577,975.41	0.83
9	111810403	18兴业银行CD403	2,000,000	199,133,913.04	0.77
10	111811243	18平安银行CD243	2,000,000	199,099,517.61	0.77

5.7"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1584%
报告期内偏离度的最低值	0.0704%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1020%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本报告期内，本基金未发生负偏离度的绝对值达到0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：本报告期内，本基金未发生正偏离度的绝对值达到0.5%情况。

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。

5.9投资组合报告附注

5.9.1

本基金估值采用摊余成本法计价，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

5.9.2

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、处罚的情形。

5.9.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	115,228,655.24
4	应收申购款	49,951,974.39
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	165,180,629.63

§6开放式基金份额变动

单位：份

项目	报告期期初基金份额总额	报告期期间基金总申购份额	报告期期间基金总赎回份额	报告期期末基金份额总额
汇添富货币A	228,813,596.15	191,246,944.87	157,331,407.79	262,729,133.23
汇添富货币B	12,684,723,184.66	10,523,308,699.97	4,965,468,529.19	18,242,563,355.44
汇添富货币C	2,995,466,322.33	19,369,815,949.63	18,241,830,607.40	4,123,451,664.56
汇添富货币D	3,714,613,094.79	3,316,594,253.61	3,723,560,590.66	3,307,646,757.74

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交易明细

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、中国证监会批准汇添富货币市场基金募集的文件；

2、《汇添富货币市场基金基金合同》；

3、《汇添富货币市场基金托管协议》；

4、《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、报告期内汇添富货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告；

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

2018年10月26日