汇添富收益快钱货币市场基金

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：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	汇添富快钱货币	
场内简称	添富快钱	
交易代码	159005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年12月23日	
报告期末基金份额总额	3,489,385.00份	
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
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	活期存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富收益快钱A	汇添富收益快钱B
下属分级基金的交易代码	159005	159006
报告期末下属分级基金的份额总额	773,599.00份	2,715,786.00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）	
	汇添富收益快钱A	汇添富收益快钱B
1.本期已实现收益	644,443.83	1,188,752.68
2.本期利润	644,443.83	1,188,752.68
3.期末基金资产净值	77,359,900.00	271,578,600.00

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

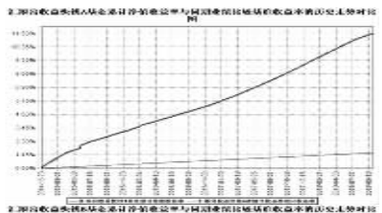
汇添富收益快钱A

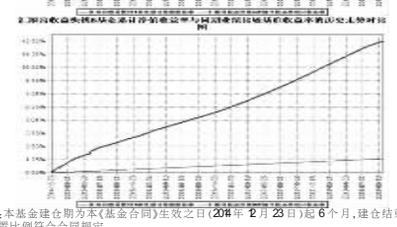
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6208%	0.0011%	0.0882%	0.0000%	0.5326%	0.0011%

汇添富收益快钱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	0.6818%	0.0011%	0.0882%	0.0000%	0.5936%	0.0011%

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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2014年2月23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

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		
陶然	汇添富现金宝货币、汇添富添富通货币、汇添富全额宝货币、汇添富收益快钱货币、汇添富收益快钱货币基金的基金经理、汇添富和聚宝货币基金、汇添富理财7天债券基金的基金经理助理	2018年5月4日	-	8年	国籍：中国，学历：法国图卢兹国立综合理工学院信息系统与软件开发硕士、法国图卢兹第一大学金融工程硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格、CFA。从业经历：曾任海富通基金、华安基金债券交易员，2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，2016年9月9日至今任汇添富和聚宝货币基金、汇添富理财7天债券基金的基金经理助理，2016年9月9日至2018年5月4日任汇添富收益快钱货币基金、汇添富收益快钱货币基金的基金经理助理，2018年5月4日任汇添富收益快钱货币基金、汇添富现金宝货币基金的基金经理助理，2018年9月13日至今任汇添富通货币基金、汇添富理财7天债券基金的基金经理助理

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

三季度美联储完成年内的第三次加息，符合市场普遍预期，并声明重申渐进式加息与美国经济持续扩张、劳动力市场表现强劲保持一致。欧洲央行称将保持利率不变至2019年夏天，与此同时向市场传递了欧元区潜在通胀出现了相对强劲态势的信号，引发未来的加息预期。日本央行则认为当前仍未到需要重新考虑货币政策的时点，将会在相当长的时间内保持目前极低的利率水平。

三季度我国宏观经济运行平稳，产出动能有所减弱，制造业投资增速企稳回升，基建投资增速承压。需要观察到中美贸易争端升级、防范化解金融风险、房地产市场发展、投资增速下滑过快等宏观经济领域面临的突出问题对稳增长形成较大程度的扰动，也使得市场对经济运行情况的判断和预期的分歧加大。

央行三季度继续执行稳健货币政策，政策重心由降杠杆向稳增长逐步倾斜。在税期、缴准、利率债与地方债发行高峰等流动性容易产生波动的时点，加大了公开市场操作和MLF的投放力度，维持银行间流动性合理充裕。随着市场对资金面宽松的预期持续改善，短期利率稳步下行，3MShibor从4.0下行至2.8附近，创2016年以来新低。

操作上，本基金采取相对灵活的投资策略，适时拉长组合剩余期限并提高组合现券持仓占比。同时，通过适度的杠杆操作提升组合收益，主动把握短期利率高位震荡的机会，在控制组合风险的前提下为持有人获取稳定回报。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富收益快钱货币A的基金份额净值收益率为0.6208%，本报告期汇添富收益快钱B的基金份额净值收益率为0.6818%，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	59,867,634.54	17.13
	其中：债券	59,867,634.54	17.13
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	65,540,338.31	18.75
	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	222,381,293.53	63.63
4	其他资产	1,720,971.80	0.49
5	合计	349,510,238.18	100.00

注：由于四舍五入的原因各比例分项之和与合计可能有尾差。

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	0.98
	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	-	-
	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	50
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	57
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：本基金本报告期无平均剩余期限超过120天的情况。

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	48.26	0.00
	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	25.78	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	17.75	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	0.00	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）	8.02	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
合计		99.81	0.00

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	29,983,394.59	8.59
	其中：政策性金融债	29,983,394.59	8.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	29,884,239.95	8.56
8	其他	-	-
9	合计	59,867,634.54	17.16
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	150223	15国开23	200,000	20,005,737.11	5.73
2	111786794	17杭州银行CD210	100,000	9,977,795.68	2.86
3	180404	18农发04	100,000	9,977,657.48	2.86
4	111882676	18宁波银行CD146	100,000	9,966,507.35	2.86
5	111817127	18北大银行CD127	100,000	9,939,936.92	2.85

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	0.1002%
报告期内偏离度的最低值	0.0239%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0579%

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

本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	502,780.01
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,218,191.79
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,720,971.80

§6开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富收益快钱A	汇添富收益快钱B
报告期期初基金份额总额	712,276.00	1,083,027.00
报告期期间基金总申购份额	55,438,877.00	17,711,788.00
报告期期间基金总赎回份额	55,377,554.00	16,079,029.00
报告期期末基金份额总额	773,599.00	2,715,786.00

注：总申购份额含因份额升降级、二级市场买入等导致的强制强增份额。总赎回份额含因份额升降级、二级市场卖出等导致的强制调减份额。

§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9月27日至2018年9月30日	0.00	1,495,012.00	459,645.00	1,035,367.00	29.67%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品持有风险

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收益快钱货币市场基金募集的文件；

2.《汇添富收益快钱货币市场基金基金合同》；

3.《汇添富收益快钱货币市场基金托管协议》；

4.基金管理人业务资格批件、营业执照；

5.报告期内收益快钱货币市场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：400-888-99B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

汇添富收益快线货币市场基金

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：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	汇添富收益快线货币	
交易代码	519888	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月21日	
报告期末基金份额总额	1,835,422,257.576.00份	
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金的投资将遵循安全性和流动性优先原则，以宏观经济和货币政策分析为基础，在严格控制风险的前提下，合理构建并及时调整投资组合，力争获得稳健的、超越业绩比较基准的收益。	
业绩比较基准	活期存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富收益快线货币A	汇添富收益快线货币B
下属分级基金的场内简称	添富快线	添富快B
下属分级基金的交易代码	519888	519889
报告期末下属分级基金的份额总额	600,783,321,929.00份	1,234,638,935,647.00份

注：本基金的基金份额净值为人民币0.01元。

§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）	
	汇添富收益快线货币A	汇添富收益快线货币B
1.本期已实现收益	55,987,382.96	135,277,451.84
2.本期利润	55,987,382.96	135,277,451.84
3.期末基金资产净值	6,007,833,219.29	12,346,389,356.47

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

汇添富收益快线货币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	0.6416%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.5534%	0.0008%

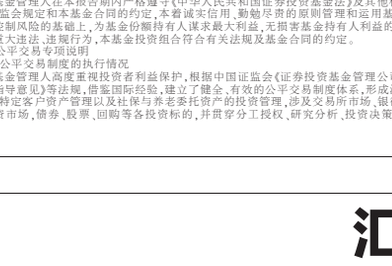
注：本基金收益分配按日结转份额。

汇添富收益快线货币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	0.7925%	0.0009%	0.0882%	0.0000%	0.7043%	0.0009%

注：本基金收益分配按日结转份额。

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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2012年2月23日）起6个月，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		
陶然	汇添富现金宝货币、汇添富添富通货币、汇添富全额宝货币、汇添富收益快线货币、汇添富收益快线货币基金的基金经理、汇添富和聚宝货币基金、汇添富理财7天债券基金的基金经理助理	2018年5月4日	-	8年	国籍：中国，学历：法国图卢兹国立综合理工学院信息系统与软件开发硕士、法国图卢兹第一大学金融工程硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格、CFA。从业经历：曾任海富通基金、华安基金债券交易员，2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，2016年9月9日至今任汇添富和聚宝货币基金、汇添富理财7天债券基金的基金经理助理，2016年9月9日至2018年5月4日任汇添富收益快钱货币基金、汇添富收益快钱货币基金的基金经理助理，2016年9月13日至2018年5月4日任汇添富收益快线货币基金的基金经理助理，2017年9月7日至今任汇添富现金宝货币、汇添富添富通货币基金的基金经理，2018年5月4日至今任汇添富全额宝货币基金、汇添富收益快线货币基金、汇添富收益快线货币基金的基金经理。

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，宏观经济数据维持弱势，投资增速缓慢下行，制造业、基建与房地产投资总体均无亮点，消费维持弱势，消费升级与降级并存，考虑到抢跑因素之后进出口数据也面临一定困难，实体企业盈利能力与此同时三季度原油因美伊冲突持续上涨，风灾水灾猪瘟等事件带动CPI略上行，尽管是几项短期因素，但一定程度上仍然引发了"滞涨"的扰动，对未来通胀产生一些分歧。三季度，央行政策保持相对宽松，7月份定向降准支持债转股，融资便利且利率处于低位，在中美贸易摩擦仍绷紧的情况下，从资产配置上债仍优于股；信用违约事件多于二季度，带动信用利差继续分化，从市场表现看，利率债总体平稳，国开略下行，地方政府债受欢迎，高评级信用债小幅下行，低评级或交仍不活跃。

股票市场在估值底部开始以震荡为主，反弹的认可度提高但力度不大，银行石化钢铁等大盘行业对指数贡献较大，进出口比例较高的纺织服装、轻工制造等跌幅较明显。主板小幅下跌12%，但中小创跌幅均超0%。

可转债三季度表现一般，7月份银行、钢铁转债等上涨抬升了转债指数，8、9月份则总体表现散乱，阴跌为主，成交量不大；部分债性转债开始得到关注。

本组合三季度净值下跌0.09%，本期组合的纯债部分相对平稳，保持了较好的流动性，可转债降低了配置，权益部分仓位较高，本季度市场风格出现变化，略有拖累。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富双利增强债券A基金份额净值为1.01元，本报告期基金份额净值增长率为-0.09%，截至本报告期末汇添富双利增强债券C基金份额净值为1.06元，本报告期基金份额净值增长率为-0.09%，同期业绩比较基准收益率为1.07%。

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	73,983,431.07	13.58
	其中：股票	73,983,431.07	13.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	452,719,827.89	83.13
	其中：债券	452,719,827.89	83.13
	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	8,938,843.17	1.64
8	其他资产	8,980,190.54	1.65
9	合计	544,622,292.67	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	47,219,682.16	10.82
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,470,600.00	0.34
J	金融业	674.98	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,978,298.18	4.12
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	7,314,175.75	1.68
S	综合	-	-
	合计	73,983,431.07	16.95

注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2018年2月23日）起6个月，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		
曾期	汇添富多元收益、可转换债券、宝安债债券、双利增强债券、汇添富安鑫智选混合、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富6月红定期开放债券基金、汇添富盈安保本混合基金、汇添富盈稳保本混合基金、汇添富长添利定期开放债券基金、添富年年益定开混合基金、添富期和混合基金、汇添富达恢混合基金的基金经理、现金管理部总经理。	2013年12月3日	-	17年	国籍：中国，学历：博士研究生，清华大学MBA，业务资格：基金从业资格，从业经历：2008年5月15日至2010年2月5日任华富货币基金的基金经理，2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强基金的基金经理，2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报基金的基金经理，2011年11月加入汇添富基金，现任固定收益投资副总监，2012年5月9日至2014年1月21日任汇添富理财30天基金的基金经理，2012年6月12日至2014年1月21日任汇添富理财60天基金的基金经理，2012年9月18日至今任汇添富多元收益基金的基金经理，2012年10月18日至2014年9月17日任汇添富理财28天基金的基金经理，2013年1月24日至2015年3月31日任汇添富理财21天基金的基金经理，2013年2月7日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理，2013年5月29日至2015年3月31日任汇添富理财7天基金的基金经理，2013年6月14日至今任汇添富宝安债基金的基金经理，2013年9月12日至2015年3月31日任汇添富现金宝货币基金的基金经理，2013年12月3日至今任汇添富双利增强债券基金的基金经理，2015年11月26日至今任汇添富安鑫智选混合基金的基金经理，2016年2月17日至今任汇添富6月红定期开放债券基金的基金经理，2016年3月18日至今任汇添富稳健添利定期开放债券基金的基金经理，2016年4月19日至今任汇添富盈安保本混合基金的基金经理，2016年8月3日至今任汇添富盈稳保本混合基金的基金经理，2016年9月29日至今任汇添富年鑫保本混合基金的基金经理，2016年12月6日至今任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理，2017年5月15日至今任添富年年益定开混合的基金经理，2018年2月11日至今任添富期和混合的基金经理，2018年7月6日至今任汇添富达恢混合基金的基金经理。
郑慧莲	汇添富双利增强债券、汇添富双利债券、添富年年丰定开混合、添富年年泰定开混合、汇添富6月红定期开放债券、汇添富多元收益债券、添富年年益定开混合、添富年年丰定开混合、汇添富安鑫智选混合、汇添富达恢混合、添富全球消费混合（QDII）的基金经理。	2017年12月12日	-	8年	国籍：中国，学历：复旦大学会计学硕士，相关业务资格：证券投资基金从业资格、中级注册会计师，从业经历：2010年7月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任行业研究员、高级研究员。2017年5月18日至2017年12月11日任汇添富年年丰定开混合基金和汇添富6月红定开债基金的基金经理助理，2017年5月18日至2017年12月25日任汇添富年年益定开混合基金的基金经理助理。2017年12月12日至今任汇添富双利增强债券、汇添富双利债券、添富年年丰定开混合、添富年年泰定开混合、汇添富6月红定期开放债券的基金经理，2017年12月26日至今任汇添富多元收益债券、添富年年益定开混合的基金经理，2018年3月1日至今担任添富期和混合的基金经理，2018年4月2日至今任汇添富安鑫智选混合的基金经理，2018年7月6日至今任汇添富达恢混合的基金经理，2018年9月21日至今任汇添富全球消费混合（QDII）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

三季度美联储完成年内的第三次加息，符合市场普遍预期，并声明重申渐进式加息与美国经济持续扩张、劳动力市场表现强劲保持一致。欧洲央行称将保持利率不变至2019年夏天，与此同时向市场传递了欧元区潜在通胀出现了相对强劲态势的信号，引发未来的加息预期。日本央行则认为当前仍未到需要重新考虑货币政策的时点，将会在相当长的时间内保持目前极低的利率水平。

三季度我国宏观经济运行平稳，产出动能有所减弱，制造业投资增速企稳回升，基建投资增速承压。需要观察到中美贸易争端升级、防范化解金融风险、房地产市场发展、投资增速下滑过快等宏观经济领域面临的突出问题对稳增长形成较大程度的扰动，也使得市场对经济运行情况的判断和预期的分歧加大。

央行三季度继续执行稳健货币政策，政策重心由降杠杆向稳增长逐步倾斜。在税期、缴准、利率债与地方债发行高峰等流动性容易产生波动的时点，加大了公开市场操作和MLF的投放力度，维持银行间流动性合理充裕。随着市场对资金面宽松的预期持续改善，短期利率稳步下行，3MShibor从4.0下行至2.8附近，创2016年以