汇添富中证500指数型发起式证券投资基金（LOF）

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：招商证券股份有限公司
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。

基金托管人招商证券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	汇添富中证500指数
交易代码	501036
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年8月10日
报告期末基金份额总额	230,986,733.77份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%＋银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
下属分级基金的基金简称	汇添富中证500指数（LOF）A / 汇添富中证500指数（LOF）C
下属分级基金的场内简称	中证500A / 中证500C
下属分级基金的交易代码	501036 / 501037
报告期末下属分级基金的份额总额	141,131,146.29份 / 89,855,587.48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）	
	汇添富中证500指数（LOF）A	汇添富中证500指数（LOF）C
1. 本期已实现收益	-6,514,175.10	-4,149,510.26
2. 本期利润	-7,633,996.26	-4,773,008.67
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0556	-0.0551
4. 期末基金资产净值	106,841,391.25	67,890,480.13
5. 期末基金份额净值	0.7570	0.7556

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

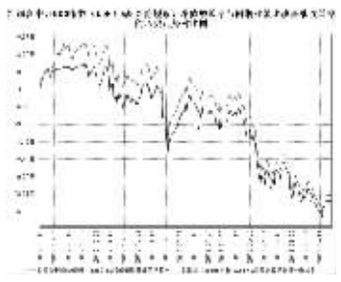
汇添富中证500指数（LOF）A

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	-6.97%	1.24%	-7.58%	1.24%	0.61%	0.00%

汇添富中证500指数（LOF）C

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	-7.01%	1.24%	-7.58%	1.24%	0.57%	0.00%

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《基金合同》生效之日为2017年8月10日，截至本报告期末，基金成立未满1年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年8月10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		
吴振翔	汇添富上证综合指数、汇添富沪深300安中指数基金、汇添富成长多因子股票基金、汇添富主要消费ETF联接基金、汇添富中证精准医疗指数基金、中证上海国企ETF、汇添富中证互联网医疗指数（LOF）、汇添富中证500指数（LOF）、添富价值多因子股票的基金经理，指数与量化投资部副总监。	2017年8月10日	-	12年	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011年9月16日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金的基金经理，2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理，2013年8月23日至2015年11月2日任中证主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金的基金经理，2013年11月6日至今任汇添富沪深300安中指数基金的基金经理，2015年2月16日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理，2015年3月24日至今任汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理，2016年1月21日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理，2016年7月28日至今任中证上海国企ETF的基金经理，2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数（LOF）的基金经理，2017年8月10日至今任汇添富中证500指数（LOF）的基金经理，2018年3月23日至今任添富价值多因子股票的基金经理。

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决策公平性，准确性和完整性承担个别及连带责任。

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

回顾三季度，经济增速回落，部分企业二季报不及预期，引发投资者对企业盈利持续下滑的担忧，同时，在国内外经济环境均趋紧的情况下，宏观经济增速下行压力加大；政策面，信用去杠杆方向不变，但边际上力度减弱，货币市场也有一定放松迹象，货币政策为应对内需和外需存在的诸多不确定性，采取了多项措施增加中长期流动性供应，降低企业融资成本，推动经济结构转型升级；中美摩擦持续超市场预期，程度加深、边际扩大，从单纯的外贸延续到政治经济等多方面；外资持续流入A股，对市场风格和投资者结构产生显著影响。

风格上，市值角度，大市值公司财务质量相对更高，抗风险能力更强，收益显著优于中小市值股票；基本面角度，部分前期相对抗跌的白马股出现了一定程度的回调，但整体看，在企业整体盈利下滑，不确定性提高的背景下，盈利质量好、治理优良的公司具有一定超额收益；前期低PB类公司超额收益明显，体现了投资者对安全性的侧重。

目前市场总体估值已经趋于合理。与历史估值相比较来看，沪深300、中证500、A股指数等大部分市场指数估值已经处于历史底部区间。在经济承压的情况下，盈利能力的变化趋势与市场估值的匹配度将仍是市场关注的焦点。

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富中证500指数（LOF）A基金份额净值为0.7570元，本报告期基金份额净值增长率为-6.97%，截至本报告期末汇添富中证500指数（LOF）C基金份额净值为0.7556元，本报告期基金份额净值增长率为-7.01%，同期业绩比较基准收益率为-7.58%。

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	163,736,453.05	93.38
	其中：股票	163,736,453.05	93.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	97,960.11	0.06
	其中：债券	97,960.11	0.06
	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	10,578,034.22	6.03
8	其他资产	933,260.28	0.53
9	合计	175,345,707.66	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末指数投资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	1,525,927.00	0.87
B	采矿业	5,365,894.84	3.07
C	制造业	96,453,689.69	55.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,930,844.60	2.82
E	建筑业	2,698,927.30	1.54
F	批发和零售业	8,708,634.21	4.98
G	交通运输、仓储和邮政业	6,233,246.90	3.57
H	住宿和餐饮业	816,206.40	0.47
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,954,437.44	7.99
J	金融业	4,324,150.91	2.47
K	房地产业	8,556,595.00	4.90
L	租赁和商务服务业	2,697,138.08	1.54
M	科学研究和技术服务业	294,731.04	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,130,988.68	0.65
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	114,732.20	0.07
Q	卫生和社会工作	246,450.12	0.14
R	文化、体育和娱乐业	3,324,635.26	1.90
S	综合	1,339,670.00	0.77
	合计	162,716,899.67	93.12

5.2.2报告期末积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	823,042.52	0.47
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	-	-
J	金融业	196,510.86	0.11
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	-	-
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	1,019,553.38	0.58

5.2.3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

5.3.1报告期末指数投资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	000661	长春高新	7,101	1,682,937.00	0.96
2	600426	华鲁恒升	63,200	1,087,672.00	0.62
3	603019	中科曙光	22,279	1,044,439.52	0.60
4	600256	广汇能源	201,830	1,031,351.30	0.59
5	000860	顺鑫农业	22,402	1,021,531.20	0.58
6	600201	生物股份	58,478	995,295.56	0.57
7	000703	恒逸石化	57,479	974,269.05	0.56
8	000977	浪潮信息	38,500	927,080.00	0.53
9	600872	中炬高新	27,704	903,150.40	0.52
10	300146	汤臣倍健	43,900	899,950.00	0.52

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	300750	宁德时代	4,489	327,697.00	0.19
2	601577	长沙银行	17,329	196,510.86	0.11
3	300724	捷佳伟创	3,870	95,859.90	0.05
4	002933	新兴装备	1,262	71,176.80	0.04
5	603583	捷昌驱动	1,321	69,339.29	0.04

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	97,960.11	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	97,960.11	0.06

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	128045	机电转债	399	45,689.49	0.03
2	113517	曙光转债	370	40,540.90	0.02
3	123015	蓝盾转债	127	11,729.72	0.01

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

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1812	IC1812	1	949,640.00	20,520.00	-
公允价值变动总额合计（元）					20,520.00
股指期货投资本期收益（元）					-631,400.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					434,440.00

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，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，以降低交易成本和组合风险，提高投资效率。

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

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	240,460.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,259.59
5	应收申购款	673,540.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	933,260.28

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不存在流通受限的情况。

§6开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证500指数（LOF）A	汇添富中证500指数（LOF）C
报告期期初基金份额总额	132,472,911.11	83,251,258.32
报告期期间基金总申购份额	16,343,941.20	21,273,158.41
减：报告期期间基金总赎回份额	7,685,706.02	14,668,829.25
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	141,131,146.29	89,855,587.48

注：其中"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

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,002,700.27
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	10,002,700.27
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	4.33

注：1.其中"申购/买入"含红利再投、转换入份额；"赎回/卖出"含转换出份额。

2.本基金于2017年8月10日成立。本公司于2017年8月2日用固有资金10,000,000.00元认购本基金份额10,002,700.27份，认购费用1000.00元。符合招募说明书规定的认购费率。

7.2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报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,700.27	4.33	10,002,700.27	4.33	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	408,505.14	0.18	-	-	-
合计	10,411,205.41	4.51	10,002,700.27	4.33	3年

§9影响投资者决策的其他重要信息

9.1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。

§10备查文件目录

10.1备查文件目录

1.中国证监会批准汇添富中证500指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；

2.《汇添富中证500指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；

3.《汇添富中证500指数型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；

4.基金管理人业务资格批件、营业执照；

5.报告期内汇添富中证500指数型发起式证券投资基金（LOF）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。

10.2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

10.3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

汇添富中国高端制造股票型证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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07月1日起至09月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	汇添富中国高端制造股票
交易代码	001725
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月20日
报告期末基金份额总额	2,943,792,426.43份
投资目标	本基金主要投资于高端制造业的优质上市公司。本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，重点投资于智能制造主题相关的优质上市公司，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金为股票型基金。投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘优质的智能制造相关上市公司。
业绩比较基准	中证智能制造主题指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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（2018年7月1日－2018年9月30日）
1.本期已实现收益	-26,324,225.81
2.本期利润	-91,334,727.31
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0308
4.期末基金资产净值	3,733,645,249.39
5.期末基金份额净值	1.268

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	-2.31%	1.35%	-6.90%	1.15%	4.59%	0.20%

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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年3月20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		
赵鹏飞	汇添富多策略定开混合、汇添富高端制造股票基金、汇添富民丰回报混合基金、汇添富弘安混合基金、汇添富睿丰混合基金、添富民安增益定开混合基金、添富智能制造股票基金的基金经理。	2017年3月20日	-	10年	国籍：中国。曾任职于日信证券、光大证券和太平洋资产，担任高级投资经理等岗位。2015年8月加入汇添富基金。2016年6月3日至今任汇添富多策略定开混合基金的基金经理，2017年3月20日至今任汇添富高端制造股票基金的基金经理，2017年9月27日至今任汇添富民丰回报基金的基金经理，2017年9月29日至今任汇添富弘安混合基金的基金经理，2017年9月29日至今任汇添富睿丰混合基金的基金经理，2018年3月19日至今任添富民安增益定开混合基金的基金经理，2018年4月23日至今任添富智能制造股票基金的基金经理。

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决策公平性，准确性和完整性承担个别及连带责任。

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

A股市场三季度表现依然很差。三季度上证50上涨5.11%，沪深300下跌2.05%，中小板指下跌11.22%，创业板指下跌12.16%。随着中美贸易战的对抗加剧，中国经济下滑趋势的信号增加，投资者对中国经济未来担忧加剧。竞争力弱的小股票连续多个季度下跌，与宏观经济相关性强的大股票也承受压力。行业来看，前三季度表现优秀的主要是食品饮料、医药和计算机等弱周期行业。

本基金在报告期没有大的策略变化。我们做了一些小仓位调整，增加了煤炭股的配置，卖出一些基本面出现恶化的个股。目前主要仓位仍然配置在白马股，主要在食品饮料、医药、采掘、金融和高端制造等板块。

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1.268元；本报告期基金份额净值增长率为-2.31%，业绩比较基准收益率为-6.90%。

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	3,046,856,755.83	80.90
	其中：股票	3,046,856,755.83	80.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	60,264,000.00	1.60
	其中：债券	60,264,000.00	1.60
	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	624,775,100.81	16.59
8	其他资产	34,362,047.52	0.91
9	合计	3,766,257,904.16	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	382,660,942.76	10.25
C	制造业	1,202,931,128.03	32.22
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	-	-
J	金融业	1,117,310,956.17	29.93
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	310,785,978.87	8.32
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	33,167,750.00	0.89
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,046,856,755.83	81.61

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。

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	601398	工商银行	53,386,543	308,040,353.11	8.25
2	600036	招商银行	8,834,839	271,141,208.91	7.26
3	601318	中国平安	3,938,972	269,819,582.00	7.23
4	600872	中炬高新	7,723,488	251,785,708.80	6.74
5	002466	天齐锂业	6,439,556	244,896,314.68	6.56
6	601601	中国太保	6,000,000	213,060,000.00	5.71
7	600887	伊利股份	8,000,000	205,440,000.00	5.50
8	002027	分众传媒	23,026,905	195,958,961.55	5.25
9	601225	陕西煤业	21,000,000	182,700,000.00	4.89
10	600867	通化东宝	8,519,747	154,548,210.58	4.14

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,264,000.00	1.61
	其中：政策性金融债	60,264,000.00	1.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	60,264,000.00	1.61

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	180407	18农发07	600,000	60,264,000.00	1.61

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：本基金本报告期末无股指期货持仓。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

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中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	783,421.65
2	应收证券清算款	28,033,466.08
3	应收股利	-
4	应收利息	982,018.74
5	应收申购款	4,563,141.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,362,047.52

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	3,010,306,945.18
报告期期间基金总申购份额	347,390,388.89
减：报告期期间基金总赎回份额	413,904,907.64
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期末基金份额总额	2,943,792,426.43

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：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中国高端制造股票型证券投资基金募集的文件；

2.《汇添富中国高端制造股票型证券投资基金基金合同》；

3.《汇添富中国高端制造股票型证券投资基金托管协议》；

4.基金管理人业务资格批