汇添富环保行业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	汇添富环保行业股票
交易代码	000696
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月16日
报告期末基金份额总额	1,719,582,854.45份
投资目标	本基金采用自下而上的策略，以基本面分析为立足点，主要投资于环保行业的优质上市公司，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金为股票型基金。股票投资的主要策略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具有核心竞争优势和持续增长潜力且估值水平相对合理的环保行业优质上市公司，辅以严格的风险管理，以获得中长期的较高投资收益。投资策略的重点是个股精选策略。
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率80%+中证全债指数收益率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、预期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	中国建设银行股份有限公司

§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	-203,625,643.09
2.本期利润	-180,797,632.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1049
4.期末基金资产净值	1,748,768,448.27
5.期末基金份额净值	1.017

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。

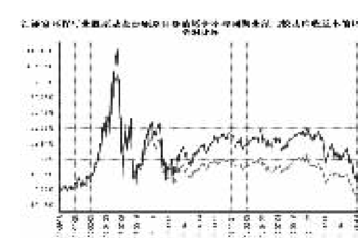
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-9.36%	1.39%	-8.90%	0.89%	-0.46%	0.50%

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》生效日（2014年9月16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		
叶从飞	汇添富环保行业股票的基金经理。	2014年9月16日	-	14年	国籍：中国。学历：南京大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任中原证券股份有限公司资产管理部交易员、投资经理助理。2005年10月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任交易主管、基金经理助理，2012年3月2日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合基金的基金经理，2013年11月22日至2015年7月30日任汇添富蓝筹稳健混合基金的基金经理，2014年9月16日至今任汇添富环保行业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

2018年三季度A股市场继续下跌，在经济下行、人民币贬值以及中美贸易摩擦等负面因素影响下，市场风险偏好持续下降。从行业表现看，银行、非银金融和采掘板块涨幅居前，而家电、纺织服装和医药生物板块跌幅较大。从市场风格看，市场避险情绪较重，除金融、采掘等高分红的价值股表现较好外，其他行业均出现不同程度下跌。本基金三季度采取了相对防御的策略，减持了组合中流动性较差的股票，增加了低估值蓝筹股的持仓比重。由于维持了偏高的股票仓位，三季度本基金净值小幅跑输业绩比较基准。

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1.017元；本报告期基金份额净值增长率为-9.36%，业绩比较基准收益率为-8.90%。

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	1,565,203,701.79	87.35
	其中：股票	1,565,203,701.79	87.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	80,008,000.00	4.47
	其中：债券	80,008,000.00	4.47
	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	118,613,663.86	6.62
8	其他资产	28,053,061.02	1.57
9	合计	1,791,878,426.67	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	81,560,856.38	4.66
C	制造业	1,068,240,119.92	61.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,289,506.71	2.53
E	建筑业	115,199,411.31	6.59
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	70,733,164.08	4.04
J	金融业	-	-
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	35,040,000.00	2.00
N	水利、环境和公共设施管理业	114,824,730.20	6.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,615,913.19	0.49
R	文化、体育和娱乐业	26,700,000.00	1.53
S	综合	-	-
	合计	1,565,203,701.79	89.50

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。

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	601222	林洋能源	35,999,944	168,479,737.92	9.63
2	002672	东江环保	13,500,099	154,576,133.55	8.84
3	603799	华友钴业	1,540,042	82,068,838.18	4.69
4	300203	聚光科技	3,300,000	81,906,000.00	4.68
5	601088	中国神华	4,000,042	81,560,856.38	4.66
6	601668	中国建筑	14,000,079	76,860,433.71	4.40
7	300618	寒锐钴业	600,000	76,518,000.00	4.38
8	002466	天齐锂业	2,000,008	76,060,304.24	4.35
9	300750	宁德时代	1,000,000	73,000,000.00	4.17
10	600406	国电南瑞	4,000,000	70,600,000.00	4.04

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	80,008,000.00	4.58
	其中：政策性金融债	80,008,000.00	4.58
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	80,008,000.00	4.58

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	160415	16农发15	800,000	80,008,000.00	4.58

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：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

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	356,635.13
2	应收证券清算款	25,997,652.09
3	应收股利	-
4	应收利息	1,117,054.89
5	应收申购款	581,718.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,053,061.02

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未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	1,727,781,997.66
报告期期间基金总申购份额	68,373,875.17
减：报告期期间基金总赎回份额	76,573,018.38
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	1,719,582,854.45

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环保行业股票型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富环保行业股票型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富环保行业股票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、报告期内汇添富环保行业股票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

汇添富添福吉祥混合型证券投资基金

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	添富添福吉祥混合
交易代码	004774
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年7月24日
报告期末基金份额总额	261,796,581.65份
投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，适度投资权益类品种以增强收益，在科学严格管理风险的前提下，力争实现稳定的绝对回报，为投资者提供稳健收益的理财工具。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略，通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益，并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报，在灵活配置各类资产以及严格的风险管理基础上，力争实现基金资产的持续稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*20%+中债综合指数收益率*80%
风险收益特征	本基金为债券投资为主的混合型基金，属于中低风险、中低收益预期的基金品种，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于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（2018年7月1日－2018年9月30日）
1.本期已实现收益	5,720,109.82
2.本期利润	1,148,830.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0040
4.期末基金资产净值	277,920,938.14
5.期末基金份额净值	1.0616

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	0.45%	0.27%	0.05%	0.27%	0.40%	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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年7月24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		
何旻	汇添富安心中国债券基金、汇添富6月红定期开放债券基金、汇添富盈鑫保本混合基金、汇添富美元债债券（QDII）基金、添富添福吉祥混合基金、添富盈润混合基金、汇添富弘安混合基金、添富配售基金的基金经理。	2017年7月24日	-	20年	国籍：中国。学历：英国伦敦政治经济学院金融经济学硕士。相关业务资格：基金从业资格、特许金融分析师（CFA），财务风险经理人（FRM）。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司行业研究员、综合研究小组负责人、基金经理助理，固定收益部负责人；金元比联基金管理有限公司基金经理。2004年10月28日至2006年11月11日担任国泰金龙债券基金的基金经理，2005年10月27日至2006年11月11日担任国泰金象保本基金的基金经理，2006年4月28日至2006年11月11日担任国泰金鹿保本基金的基金经理。2007年8月15日至2010年12月29日担任金元比联宝石动力双利债券基金的基金经理，2008年9月3日至2009年3月10日担任金元比联成长动力混合基金的基金经理，2009年3月29日至2010年12月29日担任金元比联丰利债券基金的基金经理。2011年1月加入汇添富资产管理（香港）有限公司，2012年2月17日至今任汇添富人民币债券基金的基金经理。2012年8月加入汇添富基金管理股份有限公司，2013年11月22日至今任汇添富安心中国债券基金的基金经理，2014年1月21日至今任汇添富6月红定期开放债券基金（原汇添富信用债债券基金）的基金经理，2016年3月11日至今任汇添富盈鑫保本混合基金的基金经理，2017年4月20日至今任汇添富美元债债券（QDII）基金的基金经理，2017年7月24日至今任添富添福吉祥混合基金的基金经理，2017年9月6日至今任添富盈润混合基金的基金经理，2017年9月29日至今任汇添富弘安混合基金的基金经理，2018年7月5日至今任添富配售基金的基金经理。
胡昕炜	汇添富消费行业混合基金、添富添福吉祥混合基金、添富盈润混合基金、添富价值创造定开混合、添富全球消费混合（QDII）基金的基金经理。	2017年7月28日	-	7年	国籍：中国。学历：清华大学工学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011年加入汇添富基金任行业分析师。2016年4月8日至今任汇添富消费行业混合基金的基金经理，2017年7月28日至今任添富添福吉祥混合基金的基金经理，2017年9月20日至今任添富盈润混合基金的基金经理，2018年1月19日至今任添富价值创造定开混合基金的基金经理，2018年9月21日至今任添富全球消费混合（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

2018年6月起，CPI逐月回升，8月份达到2.30%，为近年来除去2018年2月外的高点。去除了食品和能源价格之后的核心CPI也是逐月回升至2.00%。虽然回升幅度不大，但是已经引起市场人士关注。PPI的走势与CPI相反，在6月份达到今年以来的最高点4.70%后开始回落，8月份回到4.10%。中国制造业采购经理指数PMI在7月稍有回落之后，基本平稳，其中的新订单分项指数下降至52.2。宏观基本面数据在今年第三季度涨跌互现。投资数据方面，固定资产投资和房地产投资的同比增速都在回落。制造业投资累计同比增速承接第二季度趋势，仍在反弹。从房地产的细项数据上看，70个大中城市商品房价格指数在第三季度有明显回升，8月份的同比涨幅达到2017年8月份的水平。销售额、销售面积和新开工面积的累计增速都有小幅反弹。货币政策方面，第三季度央行通过公开市场操作回笼货币2400亿元。M1同比增速在第三季度仍然在下降，8月份增速仅为3.90%，创下历史新低。M2同比增速仍然在低位徘徊，8月份维持在8.20%水平。整个债券市场在第三季度呈现资金宽松的局面，只是在9月底短暂出现资金利率上升的情况。人民币兑美元汇率在第三季度继续贬值，至9月底基本回到17年5月的汇率水平。第三季度各月份的外汇占款增加额在7月份达到108亿元，是2015年10月以来的最高值，但是在8月份又出现负增长。

在第三季度，7月份债券市场在资金面宽松的局面下收益率快速下降。进入8月份由于货币政策趋于中性，以及对后期通货膨胀上升的预期，市场利率出现上升。9月份市场收益率震荡向下。中债综合财富指数上涨1.48%。月度表现上，第三季度的3个月都获得正回报。股票市场第三季度沪深300指数下跌2.05%。

本基金在第三季度，主要是买入长期利率债券和信用债券，增加了组合中债券的久期。同时提高了组合的杠杆比例。股票方面，主要是波段操作，报告期末的股票比例较二季度末略有下降。

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1.0616元；本报告期基金份额净值增长率为0.45%，业绩比较基准收益率为0.05%。

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	33,368,760.00	10.46
	其中：股票	33,368,760.00	10.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	274,010,355.00	85.91
	其中：债券	274,010,355.00	85.91
	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	5,603,934.28	1.76
8	其他资产	5,952,292.28	1.87
9	合计	318,935,341.56	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	33,368,760.00	12.01
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	-	-
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	33,368,760.00	12.01

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。

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	600519	贵州茅台	37,968	27,716,640.00	9.97
2	000651	格力电器	140,600	5,652,120.00	2.03

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	30,547,000.00	10.99
	其中：政策性金融债	30,547,000.00	10.99
4	企业债券	192,524,435.20	69.27
5	企业短期融资券	9,994,000.00	3.60
6	中期票据	37,857,000.00	13.62
7	可转债（可交换债）	3,087,919.80	1.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	274,010,355.00	98.59

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	112208	14华邦01	264,920	26,627,109.20	9.58
2	112580	17欧菲02	200,000	20,154,000.00	7.25
3	180407	18农发07	200,000	20,088,000.00	7.23
4	143251	17荣盛03	200,000	20,062,000.00	7.22
5	143258	17洋河02	200,000	19,936,000.00	7.17

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、处罚的情形。

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	34,756.12
2	应收证券清算款	2,992,799.38
3	应收股利	-
4	应收利息	2,892,160.42
5	应收申购款	32,576.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,952,292.28

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113015	隆基转债	3,087,919.80	1.11

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	312,251,897.87
报告期期间基金总申购份额	5,409,054.28
减：报告期期间基金总赎回份额	55,864,370.50
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	261,796,581.65

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添福吉祥混合型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富添福吉祥混合型证券投资基金合同》；

3、《汇添富添福吉祥混合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、报告期内汇添富添福吉祥混合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

汇添富现金宝货币市场基金

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	汇添富现金宝货币
交易代码	000330
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月12日
报告期末基金份额总额	68,480,278,039.55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

§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	671,112,898.11
2. 本期利润	671,112,898.11
3. 期末基金资产净值	68,480,278,039.55

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。

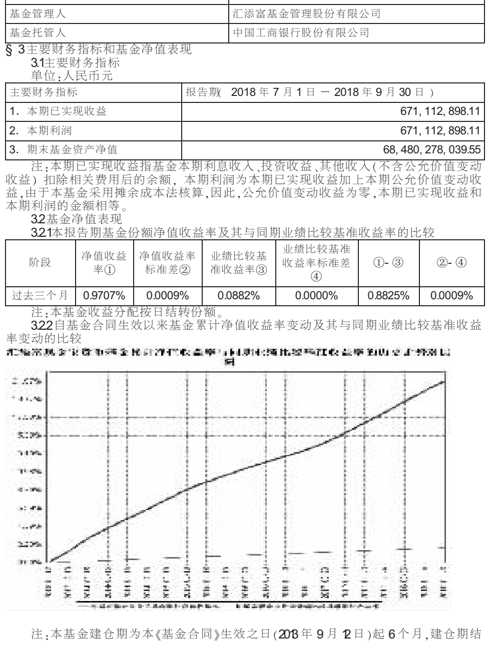
3.2基金净值表现

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

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	0.9707%	0.0009%	0.0882%	0.0000%	0.8825%	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（2013年9月12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		
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。	2015年3月10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。
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	2017年9月7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日任汇添富收益快线货币基金、汇添富全额宝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

3季度内忧外困的形势不改，中美贸易摩擦短期内难以化解，诸多新兴市场国家在美国加息的冲击下陷入汇率大幅贬值、通胀走高的困境，国内宏观经济延续疲弱态势，固定收益投资继续探底，工业增加值同比增速在6%左右低位徘徊，社会消费品零售总额也维持在9%的较低增速，乘用车销量自二季度以来大幅下行也从微观层面证实了消费的疲软。然而，经济走弱的同时，居民消费价格却不断走高，受猪价、原油和工业品价格上涨的影响，CPI逐渐突破2%，引发市场对于通胀的担忧。基于形势的严峻，国常会和政治局会议先后召开会议，强调稳增长的重要性，并定调财政政策更加积极，下半年发力点是基建补短板，货币政策继续偏稳健，将流动性保持在合理充裕的水平。受制于汇率、通胀和基本面的矛盾，稳增长政策和货币政策存在较强约束，三季度债券市场相应表现出纠结和震荡的格局，10年国开相对于上季度仅下降5BP，5年国开降幅14BP，而短债受益于资金面放松有较大幅度地下行，1年金融债收益率为3.08%，相比上季度末下降约60BP，半年-1年期大额同业存单收益率亦大幅下行30-50BP。

考虑到资金面整体仍较为宽松，本基金在投资策略上依然较为乐观，维持组合较长的剩余期限，并利用震荡格局进行波段交易操作，为投资人获取更好的收益。在个券选择方面，仍然回避可能有信用风险的中低评级债券，以流动性较好的NCD、AAA债券为主。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为0.9707%，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	34,533,034,451.11	46.88
	其中：债券	34,325,292,615.81	46.60
	资产支持证券	207,741,835.30	0.28
2	买入返售金融资产	2,290,000,000.00	3.11
	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	36,304,320,532.50	49.28
4	其他资产	538,989,030.38	0.73
5	合计	73,666,344,013.99	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	6.09	
	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	5,149,793,595.22	7.52
	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	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	102

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120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	11.28	7.52
	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	16.18	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	37.61	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	1.94	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）	39.78	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
	合计	106.79	7.52

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：本报告期内本货币市场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	4,711,394,766.11	6.88
	其中：政策性金融债	4,711,394,766.11	6.88
4	企业债券	79,753,851.59	0.12
5	企业短期融资券	1,669,157,292.56	2.44
6	中期票据	-	-
7	同业存单	27,864,986,705.55	40.69
8	其他	-	-
9	合计	34,325,292,615.81	50.12
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	11,080,000	1,109,883,086.17	1.62
2	111805195	18建设银行CD195	11,000,000	1,085,140,662.32	1.58
3	180201	18国开01	10,000,000	1,001,139,963.68	1.46
4	111805193	18建设银行CD193	10,000,000	995,112,255.14	1.45
5	111884379	18北京农商银行CD072	10,000,000	986,109,988.88	1.44
6	111809289	18浦发银行CD289	10,000,000	984,017,225.50	1.44
7	170211	17国开11	8,700,000	869,908,518.72	1.27
8	111884161	18成都农商银行CD013	7,000,000	696,459,241.50	1.02
9	180207	18国开07	6,800,000	679,751,292.62	0.99
10	111815424	18民生银行CD424	6,200,000	611,498,286.67	0.89

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	0.2314%
报告期内偏离度的最低值	0.1101%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1505%

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

序号	债券代码	债券名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	149554	宁远04A2	600,000	60,000,000.00	0.09
2	156005	宁远06A1	500,000	50,000,000.00	0.07
3	1889098	18融腾2A1_bc	800,000	45,716,835.30	0.07
4	149731	宁远05A1	400,000	40,000,000.00	0.06
5	1889112	18上和1A1	500,000	12,025,000.00	0.02

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	10,838.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	538,978,191.94
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	538,989,030.38

§6开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	66,537,841,388.98
报告期期间基金总申购份额	101,249,534,743.80
报告期期间基金总赎回份额	99,307,098,093.23
报告期期末基金份额总额	68,480,278,039.55

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

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	22-申购	2018年7月4日	170,000,000.00	170,000,000.00	0.00%
2	24-赎回	2018年7月13日	70,000,000.00	-70,000,000.00	0.00%
3	22-申购	2018年7月24日	60,000,000.00	60,000,000.00	0.00%
4	22-申购	2018年8月7日	103,475,503.42	103,475,503.42	0.00%
5	24-赎回	2018年8月10日	40,000,000.00	-40,000,000.00	0.00%
6	24-赎回	2018年8月13日	70,000,000.00	-70,000,000.00	0.00%
7	22-申购	2018年8月22日	30,000,000.00	30,000,000.00	0.00%
8	22-申购	2018年8月30日	30,000,000.00	30,000,000.00	0.00%
9	22-申购	2018年9月10日	82,611,079.89	82,611,079.89	0.00%
10	24-赎回	2018年9月10日	30,000,000.00	-30,000,000.00	0.00%
11	24-赎回	2018年9月27日	510,000,000.00	-510,000,000.00	0.00%
合计			1,196,086,583.31	-243,913,416.69	

注：除上述交易明细外，基金管理人的47090687597帐户本季度申购共计人民币10,000,000.00元，赎回共计人民币6,314,477.26元，适用费率均为0%。

§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现金宝货币市场基金募集的文件；

2、《汇添富现金宝货币市场基金基金合同》；

3、《汇添富现金宝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、报告期内汇添富现金宝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：400-888-9918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