汇添富3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（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：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	添富配售
场内简称	添富配售
交易代码	501188
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年7月5日
报告期末基金份额总额	14,436,240,692.05份
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要投资通过战略配售获得的股票，在封闭运作期内主要采用战略配售策略和债券投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*60%+中债总指数收益率*40%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。 本基金以投资战略配售股票为主要投资策略，需参与并接受发行人战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。
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

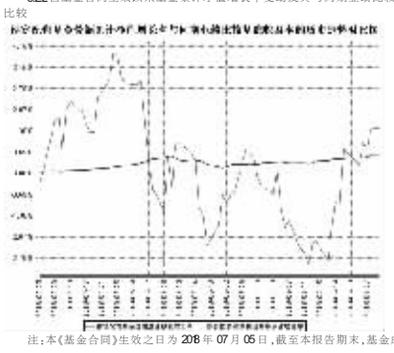
主要财务指标	报告期（2018年7月5日－2018年9月30日）
1.本期已实现收益	109,581,824.47
2.本期利润	85,377,845.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0059
4.期末基金资产净值	14,521,618,537.60
5.期末基金份额净值	1.0059

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
自基金成立以来	0.59%	0.03%	1.47%	0.79%	-0.88%	-0.76%

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2018年07月05日，截至本报告期末，基金成立未满6个月；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2018年07月05日）起6个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

§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		
刘伟林	汇添富新兴消费股票基金、添富配售基金的基金经理。	2018年7月5日	-	10年	国籍：中国。学历：北京大学经济学硕士、相关业务资格；证券投资基金从业资格。从业经历：2008年7月加入汇添富基金任行业分析师，2010年5月至2011年3月在国家发展和改革委员会工作，2011年3月至今在我司担任高级策略分析师，2015年12月2日至今任汇添富新兴消费股票基金的基金经理，2018年7月5日至今任添富配售基金的基金经理。
何受	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、添富添瑞吉祥混合基金、添富双鸿混合基金、汇添富弘安混合基金、添富配售基金的基金经理。	2018年7月5日	-	20年	杨塔 汇添富全球移动互联混合基金、汇添富文体娱乐混合基金、添富配售基金的基金经理 2018年7月5日 - 8年 国籍：中国。学历：清华大学工程学硕士、相关业务资格；证券投资基金从业资格。从业经历：2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司，2010年8月至2017年1月担任公司的TMT行业分析师，2017年1月25日至今任汇添富全球移动互联混合基金的基金经理，2018年6月21日至今任汇添富文体娱乐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。 刘江 汇添富医疗服务混合基金、添富全球医疗混合（QDII）基金、添富配售基金、添富创新医药混合基金的基金经理。 2018年7月5日 - 7年 国籍：中国。学历：清华大学工学硕士，德国亚琛工大工学硕士。相关业务资格；证券投资基金从业资格。从业经历：2011年5月加入汇添富基金管理股份有限公司任医药行业分析师，2015年6月18日至今任汇添富医疗服务混合基金的基金经理，2017年8月16日至今任添富全球医疗混合(QDII)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，2018年8月8日至今任添富创新医药混合基金的基金经理。

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4.0%。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7月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%。

本基金成立于7月上旬，在债券建仓策略上主要从3年运作的角度来考虑，品种上选择流动性好、信用安全性高的债券。重点配置交易所的公司债券和银行间的同业存单，少量配置利率债券以及中期票据。同时亦在积极寻找股票的战略配售机会。

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1.0059元；本报告期基金份额净值增长率为0.59%，业绩比较基准收益率为1.47%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,571,355,715.00	93.35
	其中：债券	13,571,355,715.00	93.35
	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	720,000,000.00	4.95
	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	134,969,888.64	0.93
8	其他资产	112,533,918.39	0.77
9	合计	14,538,859,522.03	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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	328,734,000.00	2.26
	其中：政策性金融债	328,734,000.00	2.26
4	企业债券	5,440,497,715.00	37.46
5	企业短期融资券	1,191,519,000.00	8.21
6	中期票据	881,420,000.00	6.07
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	5,729,185,000.00	39.45
9	其他	-	-
10	合计	13,571,355,715.00	93.46

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	111810373	18兴业银行CD373	4,000,000	386,040,000.00	2.66
2	111813116	18新闻银行CD116	3,300,000	317,988,000.00	2.19
3	071800029	18中信CP007BC	3,000,000	300,120,000.00	2.07
4	111881518	18天津银行CD212	3,000,000	295,080,000.00	2.03
5	111808222	18中信银行CD222	3,000,000	292,170,000.00	2.01

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

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	193,695.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	112,340,223.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	112,533,918.39

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

基金合同生效日（2018年7月5日）基金份额总额	14,436,240,692.05
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	14,436,240,692.05

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3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）募集的文件；

2.《汇添富3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3.《汇添富3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（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3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（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。

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

汇添富上证综合指数证券投资基金

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	汇添富上证综合指数
交易代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月1日
报告期末基金份额总额	1,458,441,896.21份
投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争把期末基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%，且年化跟踪误差小于6%，以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%且年化跟踪误差小于6%的投资目标。
业绩比较基准	上证综合指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
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风险较高收益的品种。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	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	4,682,648.14
2.本期利润	32,037,226.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0210
4.期末基金资产净值	1,415,451,408.09
5.期末基金份额净值	0.971

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	2.32%	1.11%	-0.87%	1.14%	3.19%	-0.03%

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（2009年7月1日）起3个月，建仓期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		
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）、汇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。	2010年2月5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、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日任汇添富沪深300ETF基金的基金经理，2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富主要消费ETF联接基金、汇添富中证精准医指数基金、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）、汇添富价值多因子股票的基金经理，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、中证金融地产ETF基金、汇添富中证500安中指数基金的基金经理，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

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

截至本报告期末本基金份额净值为0.971元；本报告期基金份额净值增长率为2.32%，业绩比较基准收益率为-0.87%。

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	1,343,114,304.63	94.73
	其中：股票	1,343,114,304.63	94.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	397,204.20	0.03
	其中：债券	397,204.20	0.03
	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	72,816,688.40	5.14
8	其他资产	1,501,985.69	0.11
9	合计	1,417,830,182.92	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	2,629,225.19	0.19
B	采矿业	163,707,408.01	11.57
C	制造业	423,116,233.08	29.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	61,040,560.44	4.31
E	建筑业	51,056,670.53	3.61
F	批发和零售业	40,317,640.60	2.85
G	交通运输、仓储和邮政业	61,752,730.80	4.36
H	住宿和餐饮业	3,315,436.30	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,060,899.75	1.63
J	金融业	432,412,848.34	30.55
K	房地产业	44,222,941.71	3.12
L	租赁和商务服务业	11,782,292.69	0.83
M	科学研究和技术服务业	2,937,156.09	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	2,701,006.66	0.19
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	13,190,807.81	0.93
S	综合	5,604,596.48	0.40
	合计	1,342,848,454.48	94.87

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	69,339.29	0.00
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	0.01
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	265,850.15	0.02

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

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	601288	农业银行	18,298,906	71,182,744.34	5.03
2	601857	中国石油	7,760,357	71,162,473.69	5.03
3	601988	中国银行	13,941,211	51,861,304.92	3.66
4	600036	招商银行	1,608,715	49,371,463.35	3.49
5	600519	贵州茅台	62,877	45,900,210.00	3.24
6	601318	中国平安	520,090	35,626,165.00	2.52
7	600028	中国石化	4,583,777	32,636,492.24	2.31
8	601328	交通银行	4,379,017	25,573,459.28	1.81
9	601628	中国人寿	1,003,371	22,756,454.28	1.61
10	601939	建设银行	2,714,411	19,652,335.64	1.39

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	601577	长沙银行	17,329	196,510.86	0.01
2	603583	捷昌驱动	1,321	69,339.29	0.00

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）	397,204.20	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	397,204.20	0.03

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	110045	海澜转债	1,640	162,934.00	0.01
2	113508	新凤转债	1,250	128,225.00	0.01
3	110043	无锡转债	1,080	106,045.20	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。

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：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资前十大证券中的中国人寿（601628.SH）于2018年7月30日发布公告，称收到《中国人民银行行政处罚决定书》（银反洗罚决字[2018]第5号）。中国人民银行认定，公司于2016年7月1日至2016年6月30日期间，未按照规定保存客户身份资料和交易记录以及未按照规定报送大额交易报告和可疑交易报告，依据《中华人民共和国反洗钱法》，公司被合计处以人民币70万元罚款。我司经过研究评估，认为此事件对中国人寿经营业绩未产生重大的实质影响，对其投资价值未产生实质影响。本基金持有该股经过合理的投资决策授权审批，符合指数基金投资管理规定。

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	45,644.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,096.94
5	应收申购款	1,442,243.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,501,985.69

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	110043	无锡转债	106,045.20	0.01

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1报告期末指数投资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。

5.11.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五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	1,558,832,862.46
报告期期间基金总申购份额	97,583,206.79
减：报告期期间基金总赎回份额	197,974,173.04
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	1,458,441,896.21

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上证综合指数证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富上证综合指数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、报告期内汇添富上证综合指数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

汇添富医疗服务灵活配置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：招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。

基金托管人招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	汇添富医疗服务混合
交易代码	001417
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效