汇添富鑫瑞债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

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:2019年7月17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2019年7月15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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富鑫瑞债券	
基金主代码	004089	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月26日	
报告期末基金份额总额	5,078,483,687.45份	
投资目标	本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、中小企业私募债券、可转换债券、可交换公司债券、可分离交易债券、债券回购、同业存单、货币市场工具、银行存款等固定收益类品种，国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。 本基金不投资股票或权证，不直接从二级市场买入可转换债券和可交换公司债券,但可以参与一级市场可转换债券和可交换公司债券的申购,并在其上市交易后10个交易日内卖出。因投资可分离交易债券而产生的权证,应当在其可上市交易后的10个交易日内卖出。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。	
投资策略	本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势,自上而下决定类属资产配置及组合久期,并依据内部信用评级系统,深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略等。在谨慎投资的基础上,力争实现组合的稳健增值。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	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	汇添富鑫瑞债券A	汇添富鑫瑞债券C
下属分级基金的交易代码	004089	004090
报告期末下属分级基金的份额总额	5,078,482,450.69份	1,236.76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(2019年4月1日 – 2019年6月30日)	
	汇添富鑫瑞债券A	汇添富鑫瑞债券C
1.本期已实现收益	34,476,928.67	7.43
2.本期利润	34,416,299.29	7.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.0068	0.0063
4.期末基金资产净值	5,197,968,640.69	1,294.83
5.期末基金份额净值	1.0235	1.0470

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

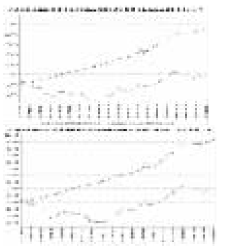
汇添富鑫瑞债券A

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	0.67%	0.04%	–0.24%	0.06%	0.91%	–0.02%

汇添富鑫瑞债券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	0.59%	0.04%	–0.24%	0.06%	0.83%	–0.02%

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（2016年12月26日）起6个月,截止至本报告期末,本基金已完成建仓,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		
胡娜	添富年年泰定开混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、添富民安增益定开混合基金、添富鑫盛定开债基金、汇添富纯债（LOF）基金的基金经理。	2017年7月3日	–	10年	国籍:中国。学历:西南财经大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历:2009年至2012年期间任职于华泰联合证券固定收益部,担任自营交易员职务;2012年11月加盟银华基金管理有限公司,曾担任研究员、基金经理助理职务，自2015年1月29日至2016年10月18日任银华增强收益债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金和银华永泰积极债券型证券投资基金基金经理。2015年5月14日至2016年10月18日任银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年5月21日至2016年10月18日任银华稳利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年11月加入汇添富基金管理股份有限公司任投资经理。2017年4月25日至2017年7月2日任添富年年泰定开混合基金、汇添富鑫瑞债券基金的基金经理助理,2017年7月3日至今任添富年年泰定开混合基金、汇添富鑫瑞债券基金的基金经理,2018年2月13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16日至今任添富鑫盛定开债基金的基金经理,2018年7月6日至今任汇添富纯债（LOF）基金的基金经理。
陆文磊	汇添富增强收益债券基金、汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富纯债(LOF)基金、汇添富鑫瑞债券基金、添富年年泰定开混合基金、添富鑫泽定开债基金的基金经理,总经理助理、固定收益投资总监。	2016年12月26日	–	17年	国籍:中国。学历:华东师范大学金融学博士。相关业务资格：基金从业资格。从业经历:曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。2007年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任总经理助理、固定收益投资总监。2008年3月6日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理,2009年1月21日至2011年6月21日任汇添富货币基金的基金经理,2011年1月26日至2013年2月7日任汇添富保本混合基金的基金经理,2012年7月26日至今任汇添富季季红定期开放债券基金的基金经理,2013年11月6日至今任汇添富纯债(LOF)基金（原汇添富互利分级债券基金）的基金经理，2013年12月13日至2015年3月31日任汇添富全额宝货币基金的基金经理,2014年1月21日至2015年3月31日任汇添富收益快线货币基金的基金经理,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的基金经理,2016年12月26日至今任汇添富鑫瑞债券基金的基金经理,2017年4月14日至今任添富年年泰定开混合基金的基金经理，2018年3月8日至今任添富鑫泽定开债基金的基金经理。

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

2019年二季度,全球经济共振回落,美国经济数据下滑明显,减税刺激消退叠加贸易摩擦反复,美国制造业与消费均呈现颓势。中国经济二季度呈现小幅回落的态势,中采制造业PMI跌至荣枯线以下,工业增加值明显回落。企业盈利继续下滑,制造业投资下滑,地产基建托底经济,但随着房地产融资收紧,销售和开工面临下滑,地产周期仍处于下行阶段。另一方面,地方专项债可作为项目资金本,预计未来地方债发行额度有所提升,基建投资有望继续企稳回升,但基建仍是托底,在管控新增地方债务的背景下,难以扭转经济的下滑趋势,下半年经济仍面临较大的下行压力。

政策层面，二季度货币政策例会对当前的宏观经济和货币政策做出了描述,当前海外不确定性增加,货币政策需适时适度实施逆周期调节,外部环境的变化有利于货币政策保持宽松,流动性充裕,而防范化解重大风险特别是金融风险仍是重中之重,预计相关措施仍将渐进式推进,风险处置的过程也需要货币政策的保驾护航。二季度,债券收益率先上后下,全季度整体小幅震荡。10年国债上行9bp,10年国开下行4bp,3年AAA中票上行4bp,5年AAA中票上行2bp,3年AA+中票下行1bp,5年AA+中票上行1bp。二季度股市全面下跌,上证综指下跌3.62%,深圳成指下跌7.35%,创业板下跌10.28%,中小板指下跌10.32%。

本基金二季度根据市场预判,对利率债进行了波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富鑫瑞债券A基金份额净值为1.0235元,本报告期基金份额净值增长率为0.67%；截至本报告期末汇添富鑫瑞债券C基金份额净值为1.0470元，本报告期基金份额净值增长率为0.59%；同期业绩比较基准收益率为–0.24%。

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	5,579,454,000.00	97.88
	其中:债券	5,579,454,000.00	97.88
	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	30,561,746.79	0.54
8	其他资产	90,416,300.88	1.59
9	合计	5,700,432,047.67	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

注:本基金本报告期末未持有股票。

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	200,060,000.00	3.85
2	央行票据	–	–
3	金融债券	4,701,184,000.00	90.44
	其中:政策性金融债	4,701,184,000.00	90.44
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	678,210,000.00	13.05
9	其他	–	–
10	合计	5,579,454,000.00	107.34

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（份）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	190202	19国开02	10,400,000	1,036,568,000.00	19.94
2	190203	19国开03	9,100,000	904,176,000.00	17.39
3	180208	18国开08	5,400,000	549,504,000.00	10.57
4	180212	18国开12	5,000,000	505,600,000.00	9.73
5	190401	19农发01	4,000,000	397,160,000.00	7.64

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前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查,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	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	90,416,300.88
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	90,416,300.88

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:本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富鑫瑞债券A	汇添富鑫瑞债券C
报告期期初基金份额总额	5,087,325,348.38	1,187.84
报告期期间基金总申购份额	7,121.60	77.60
减:报告期期间基金总赎回份额	8,850,019.29	28.68
报告期期末基金份额总额	5,078,482,450.69	1,236.76

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

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	2019年4月1日至2019年6月30日	1,907,214,962.25	–	–	1,907,214,962.25	37.55
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鑫瑞债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富鑫瑞债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富鑫瑞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、报告期内汇添富鑫瑞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
2019年7月17日

汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

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:2019年7月17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2019年7月15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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富鑫益定开债	
基金主代码	004469	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年4月20日	
报告期末基金份额总额	1,500,172,877.78份	
投资目标	在科学严格管理风险的前提下，本基金力争创造超越业绩比较基准的较高稳健收益。	
投资策略	本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略等。在谨慎投资的基础上,力争实现组合的稳健增值。	
业绩比较基准	中债综合指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。	
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	汇添富鑫益定开债A	汇添富鑫益定开债C
下属分级基金的交易代码	004469	004470
报告期末下属分级基金的份额总额	1,500,107,341.82份	65,535.96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(2019年4月1日 – 2019年6月30日)	
	汇添富鑫益定开债A	汇添富鑫益定开债C
1.本期已实现收益	16,665,924.77	769.29
2.本期利润	11,414,839.34	408.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.0076	0.0054
4.期末基金资产净值	1,538,560,656.06	66,604.23
5.期末基金份额净值	1.0256	1.0163

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

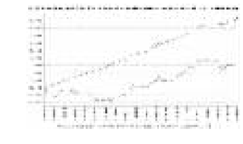
汇添富鑫益定开债A

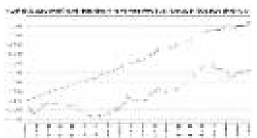
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.75%	0.03%	–0.24%	0.06%	0.99%	–0.03%

汇添富鑫益定开债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	0.64%	0.03%	–0.24%	0.06%	0.88%	–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（2017年4月20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		
吴江宏	汇添富可转换债券基金、汇添富盈安保本混合基金、汇添富盈稳保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富鑫利定开债、汇添富绝对收益定开混合、汇添富鑫益定开债、添富鑫汇定开债券基金、汇添富民丰回报混合、添富鑫永定开债、添富鑫盛定开债、添富年年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。	2017年4月20日	–	8年	国籍：中国，学历：厦门大学经济学硕士。2011年加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益分析师。2015年7月17日至今任汇添富可转换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日至今任汇添富保鑫保本混合基金的基金经理,2017年3月13日至今任汇添富鑫利定开债基金（原添富鑫利债券基金）的基金经理,2017年3月15日至今任汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理,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6月23日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理,2017年9月27日至今任汇添富民丰回报混合基金的基金经理,2018年1月25日至今任添富鑫永定开债基金的基金经理,2018年4月16日至今任添富鑫盛定开债基金的基金经理,2018年9月28日至今任添富年年丰定开混合、汇添富双利债券的基金经理。
蒋文玲	现金宝货币基金、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（LOF）基金、汇添富新睿精选混合基金、添富短债债券基金、添富丰润中短债基金、汇添富丰利短债基金、汇添富90天短债基金的基金经理,汇添富多元收益债券基金的基金经理助理。	2017年4月20日	–	13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2019年1月25日任汇添富货币基金的基金经理,2016年6月7日至今任实业债债券基金的基金经理,2016年6月7日至2019年1月25日任添富通货币基金的基金经理,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（LOF）基金、汇添富新睿精选混合基金的基金经理,2018年12月13日至今任添富短债债券基金的基金经理,2018年12月24日至今任添富丰润中短债基金的基金经理,2019年1月18日至今任汇添富丰利短债基金的基金经理,2019年6月12日至今任汇添富90天短债基金的基金经理。

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,并经过公司内部风控审核。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

二季度经济供需双弱,工业增加值持续走低,固定资产投资增速持续回落。一季度社融天量投放,二季度社融投放总量有所回落,但仍然偏积极。政策面,政策相机抉择的特征表现明显。3月经济数据超预期,政策结束前期的危机模式,强化中长期的改革开放和结构性调整。4、5月经济下行压力显现,贸易战出现反复,逆周期调节政策逐步出台。

二季度,债券收益率先上后下。1年国开上行20BP至2.73%,10年国债持平在3.6%。信用债跟随利率债走势以上行为主,不过信用利差有所压缩。二季度中债总财富指数上涨0.38%。

报告期内,组合主要配置高等级信用债。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富鑫益定开债A基金份额净值为1.0256元,本报告期基金份额净值增长率为0.75%；截至本报告期末汇添富鑫益定开债C基金份额净值为1.0163元,本报告期基金份额净值增长率为0.64%;同期业绩比较基准收益率为–0.24%。

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	1,808,866,000.00	98.32
	其中:债券	1,808,866,000.00	98.32
	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	780,447.51	0.04
8	其他资产	30,099,941.23	1.64
9	合计	1,839,746,388.74	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。

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	799,487,000.00	51.96
	其中:政策性金融债	99,960,000.00	6.50
4	企业债券	303,360,000.00	19.72
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	557,104,000.00	36.21
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	48,395,000.00	3.15
9	其他	100,520,000.00	6.53
10	合计	1,808,866,000.00	117.56

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（份）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	1728009	17招商银行01	1,300,000	131,339,000.00	8.54
2	1728008	17浦发银行02	1,300,000	131,326,000.00	8.54
3	1780085	17铁道06	1,000,000	102,910,000.00	6.69
4	1728014	17华夏银行01	1,000,000	101,990,000.00	6.63
5	1728010	17平安银行债	1,000,000	101,880,000.00	6.62

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前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查,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	14,821.37
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	30,085,119.86
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	30,099,941.23

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末无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:本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富鑫益定开债A	汇添富鑫益定开债C
报告期期初基金份额总额	1,500,121,724.60	92,741.01
报告期期间基金总申购份额	1,006.71	–
减:报告期期间基金总赎回份额	15,389.49	27,205.05
报告期期末基金份额总额	1,500,107,341.82	65,535.96

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

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	2019年4月1日至2019年6月30日	1,500,066,500.00	–	–	1,500,066,500.00	99.99
个	–	–	–	–	–	–	–
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,很可能出现开放期最后一日基金资产净值加上当日净申购的基金份额对应的资产净值减去当日净赎回的基金份额对应的资产净值低于5000万元的情形，按照法律法规与《基金合同》的约定,本基金将面临提前终止基金合同的风险。若未触发前述提前终止情形,持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，本基金有可能在运作过程中资产规模长期低于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鑫益定期开放债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富鑫益定期开放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、报告期内汇添富鑫益定期开放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
2019年7月17日

汇添富养老目标日期2030三年持有期混合型基金中基金（FOF）

2019年第二季度报告

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:2019年7月17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2019年7月15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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富养老2030三年持有混合（FOF）
基金主代码	006763
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月27日
报告期末基金份额总额	268,789,294.26份
投资目标	本基金随着所设定目标日期的临近,逐步降低权益类资产的配置比例,增加非权益类资产的配置比例,采用成熟的资产配置策略,合理控制投资组合波动风险,追求养老资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用目标日期策略,即随着所设定目标日期2030年的临近,逐步降低权益类资产的配置比例,增加非权益类资产的配置比例。 在严格控制投资组合下行风险的前提下确定大类资产配置比例，并通过全方位的定量和定性分析方法精选出优质基金组成投资组合，以期达到风险收益的优化平衡,实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证800指数收益率×X+中债综合指数收益率×（1–X）（详见基金合同）
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期风险和收益水平高于债券型基金中基金和货币型基金中基金,低于股票型基金中基金。
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(2019年4月1日 – 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	–5,825,970.74
2.本期利润	–3,965,394.86
3. 加权平均基金份额本期利润	–0.0149
4.期末基金资产净值	273,121,767.62
5.期末基金份额净值	1.0161

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。

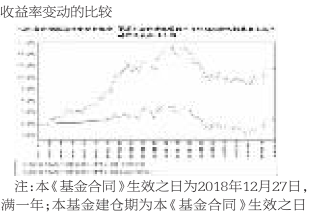
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	–1.47%	0.73%	–1.98%	0.88%	0.51%	–0.15%

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12月27日,截至本报告期末,基金成立未满一年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2018年12月27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		
蔡健林	汇添富养老2030三年持有混合（FOF）、汇添富养老2040五年持有混合（FOF）、汇添富养老2050五年持有混合（FOF）的基金经理	2018年12月27日	–	9年	国籍:中国。学历：上海交通大学硕士。相关业务资格：证券投资基金业务资格。从业经历:8年FOF投资经验，曾任太平洋资产管理有限责任公司高级投资经理，2017年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,2018年12月27日至今任汇添富养老2030三年持有混合（FOF）的基金经理，2019年4月29日至今任汇添富养老2040五年持有混合（FOF）的基金经理,2019年5月17日至今任汇添富养老2050五年持有混合（FOF）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

2019年上半年,沪深300涨幅27%,创业板上涨21%,中证转债指数上涨13%,3–5年AAA企业债上涨2.5%。股票资产上涨主要在一季度,原因是全球流动性宽松,国内货币宽松叠加信用宽松,社融增速恢复,经济增速逐渐稳定回升;中美贸易战缓和减弱市场对于全球经济下滑的担忧,大幅提升市场风险偏好。二季度货币政策微调和中美贸易战恶化,股票资产出现大幅回调;债券资产受益于流动性宽松,稳健增值。

我们遵循“策略风格相对均衡、精选优质价值基金、持仓适度集中、适时动态微调”的操作思路和风格。一季度产品建仓初期,我们以稳健积累收益为出发点,随着净值积累和对市场判断,逐渐将部分债券基金置换为了股票基金,一季度基金累积了较好的收益。一季度,成长风格基金涨幅大幅领先于价值风格基金,期间市场有一定的轮动特征,我们不追逐短期的市场趋势,在波动中择机加仓不同风格特征的基金,使得组合的持仓风格相对均衡;为了应对潜在的不确定性,部分基金兑现了一定的收益。二季度初期,货币政策微调和宏观经济转弱,股市出现回调,我们逐渐增持股票基金,中美贸易战恶化引起股票资产大幅下跌,我们的基金净值受到较大影响。基于长期价值投资,股市底部震荡期间我们陆续增持股票基金,至六月底基金建仓结束,基金净值接近一季度高点。

总体来看,权益和固收类资产合理搭配;股票基金持仓以长期稳定增值、风格特征清晰的价值型风格为主;债券基金以信用债策略为主。

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1.0161元;本报告期基金份额净值增长率为–1.47%,业绩比较基准收益率为–1.98%。

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	231,745,663.02	84.76
3	固定收益投资	10,002,000.00	3.66
	其中:债券	10,002,000.00	3.66
	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	21,201,257.45	7.75
8	其他资产	10,452,622.97	3.82
9	合计	273,401,543.44	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	10,002,000.00	3.66
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）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	10,002,000.00	3.66

5.4 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（份）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	019544	16国债16	100,000	10,002,000.00	3.66

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。

5.6 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。

5.7 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	89,921.20
2	应收证券清算款	10,000,000.00
3	应收股利	–
4	应收利息	232,141.29
5	应收申购款	130,560.48
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	10,452,622.97

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金报告期末未持有可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

§6 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	001725	汇添富高端制造股票	契约型开放式	19,019,751.10	26,038,039.26	9.53	是
2	000286	银华信用季季红债券A	契约型开放式	21,488,218.66	22,756,023.56	8.33	否
3	519068	汇添富成长焦点混合	契约型开放式	10,468,021.14	22,126,256.28	8.10	是
4	519069	汇添富价值精选混合A	契约型开放式	8,899,806.86	21,822,326.42	7.99	是
5	505888	嘉实元和混合	契约型封闭式	17,500,000.00	17,307,500.00	6.34	否
6	003612	南方卓元债券A	契约型开放式	14,741,017.13	16,626,393.22	6.09	否
7	470009	汇添富民营活力混合A	契约型开放式	5,305,021.44	15,209,496.47	5.57	是
8	485111	工银瑞信双利债券A	契约型开放式	8,946,317.96	13,643,134.89	5.00	否
9	470028	汇添富社会责任混合	契约型开放式	7,632,060.57	11,425,194.67	4.18	是
10	000342	嘉实新兴市场债券(QDII)A1	契约型开放式	8,122,664.50	10,738,162.47	3.93	否

注:本基金本报告期末投资于本基金管理人以及关联方所管理基金的公允价值为117,248,343.70元,占期末净值比例42.93%。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2019年04月01日至2019年06月30日	其中:交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	2,000.00	–
当期交易基金产生的赎回费（元）	59,900.00	–
当期持有基金产生的应支付的销售服务费（元）	–	–
当期持有基金产生的应支付的管理费（元）	538,011.36	279,419.55
当期持有基金产生的应支付的托管费（元）	100,345.06	46,611.36
当期交易基金产生的交易费（元）	2,800.23	–

注:当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值,上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定,基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费,基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外）,应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取,并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用,其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行,销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

注:无

§7 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	260,982,704.10
报告期期间基金总申购份额	7,806,590.16
减:报告期期间基金总赎回份额	–
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	268,789,294.26

§8 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。

§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养老目标日期2030三年持有期混合型基金中基金（FOF）募集的文件;

2、《汇添富养老目标日期2030三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》;

3、《汇添富养老目标日期2030三年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、报告期内汇添富养老目标日期2030三年持有期混合型基金中基金（FOF）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
2019年7月17日