汇添富高息债债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25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2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富高息债债券
交易代码	000174
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月27日
报告期末基金份额总额	1,712,850,133.14份
投资目标	本基金以高息债为主要投资对象,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力争实现资产的稳健增值。
投资策略	本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%;其中对高息债的投资比例不低于非现金基金资产的80%,高息债指信用评级在AA+(含AA+)和A1(含A1)之间的债券以及法律法规或监管机构未强制要求评级的债券类金融工具;基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
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	中国农业银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	汇添富高息债A	汇添富高息债C
下属分级基金的交易代码	000174	000175
报告期末下属分级基金的份额总额	1,691,489,062.99份	21,361,070.15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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)	
	汇添富高息债A	汇添富高息债C
1. 本期已实现收益	20,181,379.98	145,550.88
2. 本期利润	14,786,854.45	83,967.59
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0071	0.0046
4. 期末基金资产净值	2,360,543,560.89	29,247,091.01
5. 期末基金份额净值	1.396	1.369

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

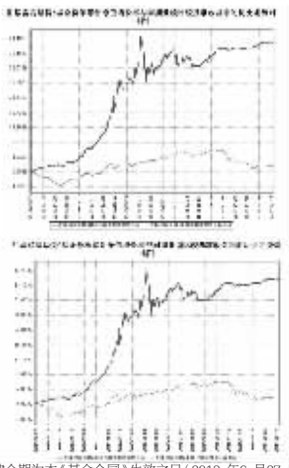
汇添富高息债A

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	0.50%	0.04%	-0.15%	0.03%	0.65%	0.01%

汇添富高息债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	0.37%	0.04%	-0.15%	0.03%	0.52%	0.01%

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(2013年6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		
陈加荣	汇添富双利债券基金、汇添富高息债债券基金、汇添富年年利定期开放债券基金、添富年年丰定开混合基金的基金经理。	2013年6月27日	-	16年	国籍:中国,学历:天津大学管理工程硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾在中国平安集团任债券研究员、交易员及本外币投资经理,国联安基金公司任基金经理助理,债券组合经理,农银汇理基金公司任固定收益投资负责人,2008年12月23日到2011年3月21日任农银汇理恒久增利债券基金的基金经理,2009年4月2日到2010年5月9日任农银汇理平衡双利混合基金的基金经理。2012年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任金融工程部高级经理、基金经理助理。2012年12月21日至2014年1月25日任汇添富收益快钱货币基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富双利债券基金的基金经理,2013年2月28日至2015年8月29日任汇添富信用债债券基金的基金经理,2015年4月27日至今任汇添富高息债债券基金的基金经理,2013年9月6日至今任汇添富年年利定期开放债券基金的基金经理,2017年4月20日至今任添富年年丰定开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未出现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%的情况,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

六月份由监管竞赛转向监管协调以及央行超预期释放流动性引发的市场收益率的下行在三季度并未得到有效延续。市场进入三季度,大宗商品价格的大幅上涨,不仅使得市场开始憧憬经济的较好改善,同时担心通胀的反弹,更关键的是央行一改六月份的态度,一直将资金调控在紧平衡状态,三季末由于MPA考核等因素的影响,交易所回购利率大幅飙升,使得市场基本上处于震荡偏弱的状态。从中长期来看,基于经济基本面的下行压力及监管政策更趋协调的判断,债市最悲观阶段应该已经过去。

本季度本基金从过去三个季度极度偏空的判断略转中性,久期有所拉长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富高息债A基金份额净值为1.396元,本报告期基金份额净值增长率为0.50%;截至本报告期末汇添富高息债C基金份额净值为1.369元,本报告期基金份额净值增长率为0.37%;同期业绩比较基准收益率为-0.15%。

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	3,119,741,876.20	93.78
	其中:债券	3,119,741,876.20	93.78
	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	151,608,247.26	4.56
8	其他资产	55,418,995.41	1.67
9	合计	3,326,769,118.87	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。

5.4 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	69,741,000.00	2.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	239,163,000.00	10.01
	其中:政策性金融债	239,163,000.00	10.01
4	企业债券	1,639,069,679.30	68.59
5	企业短期融资券	972,815,000.00	40.71
6	中期票据	46,431,000.00	1.94
7	可转债(可交换债)	113,276,196.90	4.74
8	同业存单	39,246,000.00	1.64
9	其他	-	-
10	合计	3,119,741,876.20	130.54

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	160311	16进出11	1,100,000	109,934,000.00	4.60
2	170206	17国开06	1,000,000	99,100,000.00	4.15
3	139290	16徐高新	1,000,000	93,540,000.00	3.91
4	127313	15东丽投	800,000	78,408,000.00	3.28
5	136753	16大华02	800,000	77,400,000.00	3.24

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

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	82,721.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	55,098,030.13
5	应收申购款	238,243.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,418,995.41

5.10.4 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	132001	14宝钢EB	25,071,016.20	1.05
2	128010	顺昌转债	11,781,000.00	0.49
3	132004	15国盛EB	8,597,850.00	0.36
4	132003	15浦发EB	6,747,136.00	0.28
5	110034	九州转债	6,236,859.00	0.26
6	110031	航信转债	6,071,610.40	0.25
7	110030	格力转债	5,793,020.20	0.24
8	113009	广汽转债	5,701,950.00	0.24
9	113011	光大转债	5,571,000.00	0.23
10	132005	15国资EB	4,799,250.00	0.20
11	113010	江南转债	3,755,867.20	0.16
12	110033	国贸转债	3,062,750.00	0.13
13	120001	16以岭EB	2,780,440.00	0.12
14	123001	蓝标转债	2,137,106.40	0.09
15	132006	16皖新EB	1,995,778.40	0.08
16	110032	三一转债	1,352,967.60	0.06
17	128013	洪涛转债	581,842.50	0.02
18	128012	辉丰转债	410,600.00	0.02
19	113008	电气转债	322,604.10	0.01

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

项目	汇添富高息债A	汇添富高息债C
报告期期初基金份额总额	2,340,859,728.01	15,879,375.05
报告期期间基金总申购份额	33,896,109.10	18,389,715.75
减:报告期期间基金总赎回份额	683,266,774.12	12,908,020.65
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	1,691,489,062.99	21,361,070.15

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

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
		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	2017年7月1日至2017年9月30日	2,280,887,773.94	-	641,212,813.00	1,639,674,960.94	95.73%
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高息债债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富高息债债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富高息债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、报告期内汇添富高息债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21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
2017年10月25日

汇添富国企创新增长股票型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:2017年10月25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2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富国企创新股票
交易代码	001490
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月10日
报告期末基金份额总额	1,123,843,116.97份
投资目标	本基金采用自下而上的投资方法,以基本面分析为立足点,精选国企创新主题的优质上市公司,结合市场脉络,做中长期布局,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	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具有持续创新增长动力的国企创新主题上市公司。
业绩比较基准	中证国有企业综合指数×80% +中债综合指数×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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	48,563,442.42
2.本期利润	131,408,521.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.1057
4.期末基金资产净值	1,230,707,571.81
5.期末基金份额净值	1.095

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。

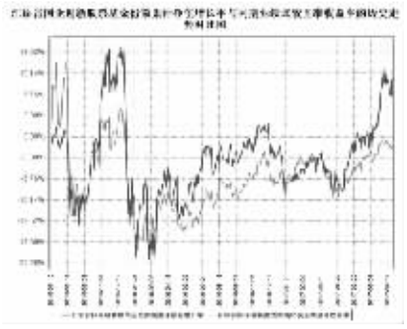
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	10.83%	0.97%	3.73%	0.52%	7.10%	0.45%

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(2015年7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		
李威	汇添富国企创新股票基金的基金经理、汇添富外延增长股票基金的基金经理。	2015年7月10日	-	8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:2008年7月加入汇添富基金管理股份有限公司任行业分析师,2015年1月29日至今任汇添富外延增长股票基金的基金经理。2015年5月25日至2017年5月19日任汇添富可转换债券基金、汇添富双利债券基金、汇添富双利增强债券基金的基金经理助理,2015年7月10日至今任汇添富国企创新股票基金的基金经理。
劳杰男	汇添富价值精选混合基金、汇添富国企创新股票基金的基金经理,研究副总监。	2015年7月10日	-	7年	国籍:中国,学历:复旦大学经济学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2010年7月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任研究副总监。2015年7月10日至今任汇添富国企创新股票基金的基金经理,2015年11月18日至今任汇添富价值精选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未出现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%的情况,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

17年3季度,从资金面来看,运动式的去杠杆取得了阶段性的成果,资金不紧不松,过度悲观的预期得到修正。经济情况来看,房地产三四线销量增速开始缓慢下滑,预计未来经济有一定压力,但是在可控范围内。

3季度上证指数上涨4.90%,深圳成指上涨5.30%,中小板指上涨8.86%,创业板指上涨2.69%。从板块表现来看,消费升级相关的白酒等表现最好,业绩确定性强的家电股表现和未来成长空间巨大的新能源车板块表现也很突出;周期股3季度表现较差,供给侧改革已经较为深入,预计年内可能是业绩的顶部。

本基金在3季度增加了新能源车、高端白酒等相关个股,成长股中优选电商、教育等坚定持有,减持了部分改革不及预期的国企以及估值到位的价值股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2017年3季度本基金收益率为10.83%

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	1,078,983,245.92	87.24
	其中:股票	1,078,983,245.92	87.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	153,036,321.44	12.37
8	其他资产	4,747,367.17	0.38
9	合计	1,236,766,934.53	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	13,132,751.28	1.07
C	制造业	786,455,116.84	63.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	29,696,000.00	2.41
F	批发和零售业	6,061,245.45	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,381,468.03	0.68
J	金融业	52,596,164.56	4.27
K	房地产业	26,124,175.40	2.12
L	租赁和商务服务业	90,405,975.67	7.35
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	37,940,045.49	3.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	10,975,426.00	0.89
Q	卫生和社会工作	17,124,211.35	1.39
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,078,983,245.92	87.67

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

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	603799	华友钴业	1,289,739	117,972,426.33	9.59
2	300338	开元股份	4,406,666	109,946,316.70	8.93
3	002127	南极电商	5,754,677	90,405,975.67	7.35
4	002236	大华股份	3,637,966	87,565,600.92	7.12
5	002460	赣锋锂业	704,621	61,513,413.30	5.00
6	600519	贵州茅台	110,889	57,400,581.96	4.66
7	002466	天齐锂业	785,862	55,238,239.98	4.49
8	601318	中国平安	970,941	52,596,164.56	4.27
9	000063	中兴通讯	1,497,957	42,392,183.10	3.44
10	002366	台海核电	1,299,862	36,838,089.08	2.99

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

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	418,687.80
2	应收证券清算款	3,814,720.87
3	应收股利	-
4	应收利息	30,467.32
5	应收申购款	483,491.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,747,367.17

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	1,336,099,824.31
报告期期间基金总申购份额	31,751,471.45
减:报告期期间基金总赎回份额	244,008,178.79
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	1,123,843,116.97

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

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	50,003,500.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	50,003,500.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.45

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、本公司于2015年7月7日用固有资金50,000,000.00元认购本基金份额50,003,500.00份(含募集期利息结转的份额),认购费用1,000.00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 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国企创新增长股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富国企创新增长股票型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富国企创新增长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、报告期内汇添富国企创新增长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21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
2017年10月25日

汇添富和聚宝货币市场基金

2017年第三季度报告

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:2017年10月25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2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富和聚宝货币
交易代码	000600
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月28日
报告期末基金份额总额	5,088,119,879.42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	上海浦东发展银行股份有限公司

§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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1. 本期已实现收益	50,346,318.49
2. 本期利润	50,346,318.49
3. 期末基金资产净值	5,088,119,879.42

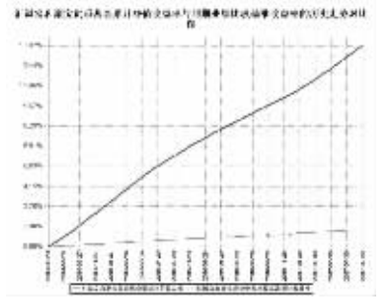
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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	1.0623%	0.0009%	0.0882%	0.0000%	0.9741%	0.0009%

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5月28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