汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金

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	汇添富蓝筹稳健混合
交易代码	519066
前端交易代码	519066
后端交易代码	519067
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月8日
报告期末基金份额总额	907,409,470.16份
投资目标	通过投资于价值相对低估的蓝筹公司股票,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为灵活配置混合型基金,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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	50,113,412.69
2.本期利润	98,715,824.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.1411
4.期末基金资产净值	2,109,033,801.29
5.期末基金份额净值	2.324

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。

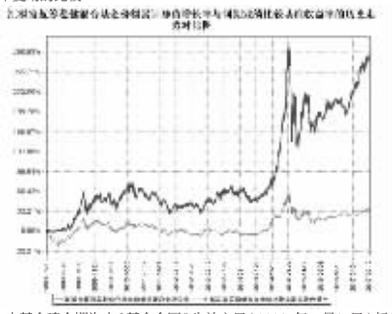
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	6.12%	0.77%	2.85%	0.36%	3.27%	0.41%

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(2008年7月8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		
谢鸣	汇添富成长焦点混合基金、汇添富蓝筹稳健混合的基金经理。	2015年1月6日	-	10年	国籍:中国。学历:华中科技大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2007年4月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任行业分析师、高级行业分析师,2014年3月27日至今任汇添富成长焦点混合基金的基金经理,2015年1月6日至今任汇添富蓝筹稳健混合股票基金的基金经理。2015年12月23日至2017年6月20日任汇添富新兴消费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

三季度市场表现继续震荡上行,市场风格有所变化,周期股异军突起,新能源汽车表现抢眼,而上半年涨幅较大的稳定增长类行业出现震荡调整走势。三季度沪深300指数上涨4.63%,上证指数上涨4.90%,创业板综指上涨4.04%。报告期内延续自下而上精选个股策略,着眼长期进行布局,关注长期持续增长动力,兼顾短期估值匹配和业绩增长,下一阶段围绕消费升级和产业转移聚焦优势行业和个股进行布局。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金2017年三季度实现收益率为6.12%,同期沪深300指数上涨4.63%。

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	1,620,601,966.93	76.58
	其中:股票	1,620,601,966.93	76.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	133,298,614.80	6.22
	其中:债券	133,298,614.80	6.22
	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	372,167,378.71	17.36
8	其他资产	18,158,083.76	0.85
9	合计	2,144,226,044.20	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	39,793.60	0.00
C	制造业	1,158,974,240.40	54.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	43,691,628.91	2.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	294,859,284.00	13.98
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	81,692,000.00	3.87
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	41,226,105.60	1.96
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,620,601,966.93	76.84

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。

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	000333	美的集团	4,350,069	192,229,549.11	9.11
2	601318	中国平安	3,500,900	189,608,744.00	8.99
3	002035	华帝股份	7,000,095	188,652,462.45	8.94
4	000651	格力电器	4,000,050	151,601,895.00	7.19
5	002572	索菲亚	3,246,421	122,714,713.80	5.82
6	601601	中国太保	2,850,000	105,250,500.00	4.99
7	600779	水井坊	2,499,923	104,546,779.86	4.96
8	601012	隆基股份	3,500,089	103,147,622.83	4.89
9	002508	老板电器	2,000,046	84,501,943.50	4.01
10	002127	南极电商	5,200,000	81,692,000.00	3.87

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)	133,298,614.80	6.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	133,298,614.80	6.32

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	132005	16国资EB	900,000	109,350,000.00	5.18
2	113011	光大转债	214,940	23,948,614.80	1.14

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

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	446,329.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,089,361.45
5	应收申购款	16,622,392.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,158,083.76

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	132005	15国资EB	109,350,000.00	5.18
2	113011	光大转债	23,948,614.80	1.14

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	478,920,976.56
报告期期间基金总申购份额	618,686,374.64
减:报告期期间基金总赎回份额	190,197,881.04
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	907,409,470.16

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	5,207,812.50
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	5,207,812.50
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.57

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2008年7月8日成立。本公司于2015年7月6日用固有资金10,000,000.00元申购本基金份额5,207,812.50份,申购费用1,000.00元。符合招募说明书规定的申购费率。

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蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富蓝筹稳健灵活配置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、报告期内汇添富蓝筹稳健灵活配置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

汇添富理财14天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	汇添富理财14天债券
交易代码	470014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月10日
报告期末基金份额总额	5,579,277,185.34份
投资目标	在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,努力追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用利率敏感型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在134天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金管理人将投资管理中的主要风险划分为投资风险、合规风险、营运风险和道德风险四大类,其中,投资风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险等。针对上述各类风险,基金管理人建立了一套完整的风险管理体系
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	汇添富理财14天债券A	汇添富理财14天债券B
下属分级基金的交易代码	470014	471014
报告期末下属分级基金的份额总额	65,375,003.81份	5,513,902,181.53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)	
	汇添富理财14天债券A	汇添富理财14天债券B
1.本期已实现收益	349,802.70	79,673,007.92
2.本期利润	349,802.70	79,673,007.92
3.期末基金资产净值	65,375,003.81	5,513,902,181.53

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

汇添富理财30天债券A

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	0.9602%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.6199%	0.0008%

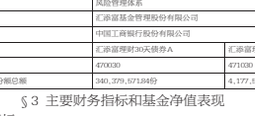
注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

汇添富理财30天债券B

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	1.0338%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.6935%	0.0008%

注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

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(2012年7月10日)起两周,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		
蒋文玲	汇添富货币基金、现金宝货币基金、汇添通货币基金、理财14天债券基金、理财30天债券基金、理财60天债券基金、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、添富年年益定开基金、汇添富鑫汇定开债券基金的基金经理。	2015年3月10日	-	11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、债券风险研究员。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、汇添富理财14天债券基金、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,2016年6月7日至今任汇添富货币基金、添富通货币基金、理财30天债券基金、理财60天债券基金、实业债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6月15日至今任添富年年益定开债券基金的基金经理,2017年6月23日至今任添富鑫汇定开债券基金的基金经理。

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、本基金的基金经理蒋文玲女士于2017年8月21日起休产假,无法正常履行职务。依据法律法规及公司制度规定,本公司研究决定,蒋文玲女士休假期间,本基金的投资管理工作由基金经理徐寅喆女士代为履行职责。本基金管理人已于2017年8月18日就上述事项进行公告。

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

2017年第三季度宏观政策环境趋稳,经济基本面韧性显著。7月初,总理讲话提出稳定宏观政策、稳定市场预期和稳定金融运行;9月底央行发布了针对普惠金融实施定向降准的通知,引导和鼓励银行资金脱虚向实。本季度房地产调控政策继续加码,一线城市上浮贷款利率,南昌、西安、长沙等几个热点二线城市出台限售条款,多个城市纷纷出台鼓励租赁住房建设的政策,房地产销售"金九银十"不再,但另一方面制造业PMI数据表现亮眼,工业企业利润同比增速也有所加快,供给侧改革成效不断稳固。海外方面,美国经济基本面强劲,失业率接连下降,薪资增长趋预期回升。这直接提振了消费需求,持续改善国内出口环境,外汇占款小幅回升,有利于国内债券市场流动性的改善。

三季度央行对流动性延续稳健中性的态度,思路上强调总量控制,操作上削峰填谷。本季度流动性环境总体平稳,但9月末银行间市场和交易所市场出现超预期的紧张,资金价格飙升至年内次高水平。债券方面,利率债与信用债收益率走势出现分化。利率债收益率出现10-20bp左右的震荡行情,季末10年国债收益率和10年国开收益率几乎与季初持平。相比,信用债收益率从8月开始出现明显上扬后仅小幅回落,相比季初出现累计近20bp的上行,同时期限利差显著缩窄。本基金考虑到三季度资金面的松紧节奏,结合组合的运作特性,对流动性管理按照份额期限进行铺排,有效控制错配风险。一方面控制组合资产久期和杠杆水平,另一方面灵活调整组合债券仓位。根据组合规模变动情况和流动性承受能力,在9月抓住存单高收益的配置机会进行积极买入,提高组合债券比例。债券选择方面,以AAA债券为主,谨慎控制AA+债券的占比;同业存款方面,结合银行评级和存款利率,灵活选择多种期限。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富理财14天债券A的基金份额净值收益率为0.9829%,本报告期汇添富理财14天债券B的基金份额净值收益率为1.0560%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

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	259,381,338.28	5.73
	其中:债券	259,381,338.28	5.73
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	4,258,213,484.39	94.09
4	其他资产	8,069,431.89	0.18
5	合计	4,525,664,251.56	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	0.06
	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	-	-
	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:本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

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	97
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	108
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

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134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	13.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	12.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	25.92	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	16.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	30.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.84	-

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	69,872,714.42	1.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	219,412,339.87	3.90
	其中:政策性金融债	219,412,339.87	3.90
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,635,856,928.40	29.32
8	其他	-	-
9	合计	1,925,140,982.69	34.51
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	170204	17国开04	2,000,000	199,634,131.38	3.58
2	111698883	16徽商银行CD099	2,000,000	199,358,569.88	3.57
3	111720156	17广发银行CD156	2,000,000	199,223,018.86	3.57
4	111710492	17兴业银行CD492	2,000,000	199,074,904.40	3.57
5	111719230	17恒丰银行CD230	1,000,000	99,682,497.28	1.79
6	111783428	17厦门国际银行CD147	1,000,000	99,371,107.00	1.78
7	111714242	17江苏银行CD242	1,000,000	99,306,186.65	1.78
8	111706081	17建设银行CD081	1,000,000	99,134,263.12	1.78
9	111784796	17宁波银行CD174	1,000,000	99,129,217.79	1.78
10	111710493	17兴业银行CD493	1,000,000	99,026,110.97	1.77

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	0.0146%
报告期内偏离度的最低值	-0.0066%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0065%

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%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%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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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、处罚的情况。

5.9.3 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	应收利息	8,069,431.89
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	8,069,431.89

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富理财14天债券A	汇添富理财14天债券B
报告期期初基金份额总额	26,545,229.04	6,622,960,275.09
报告期期间基金总申购份额	113,632,839.06	8,557,729,647.85
报告期期间基金总赎回份额	74,803,074.29	9,666,787,742.31
报告期期末基金份额总额	65,375,003.81	5,513,902,181.53

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

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	20170701-20170930	6,085,361,562.15	2,040,131,138.47	6,119,378,318.29	2,006,114,412.23	36.96%
个人	2	20170928-20170930	0.00	2,000,000,000.00	0.00	2,000,000,000.00	36.18%
	3	20170919-20170926	0.00	1,007,069,377.26	506,289,174.86	500,780,202.40	8.98%
产品持有风险							

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尽职责,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理财14天债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富理财14天债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富理财14天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、报告期内汇添富理财14天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

汇添富理财30天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