汇添富双利增强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: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	汇添富双利增强债券
交易代码	000406
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月3日
报告期末基金份额总额	714,739,705.10份
投资目标	本基金主要投资于债券资产,通过精选信用债券,并适度参与权益类品种投资,在承担合理风险和保持资产流动性的基础上,力争实现资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,其中投资于信用债券的资产不低于基金资产的60%;股票资产的投资比例合计不超过基金资产的20%;基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;持有的现金或到期日在1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	银行三年期存款税后利率+1.5%。
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	汇添富双利增强债券A / 汇添富双利增强债券C
下属分级基金的交易代码	000406 / 000407
报告期末下属分级基金的份额总额	713,425,487.11份 / 1,314,217.99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)	
	汇添富双利增强债券A	汇添富双利增强债券C
1. 本期已实现收益	8,270,961.05	39,176.70
2. 本期利润	13,697,182.33	46,475.08
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0140	0.0201
4. 期末基金资产净值	747,144,624.33	1,386,994.59
5. 期末基金份额净值	1.047	1.055

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

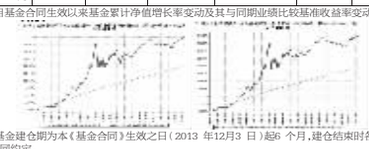
汇添富双利增强债券A

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	1.69%	0.13%	1.07%	0.01%	0.62%	0.12%

汇添富双利增强债券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	1.68%	0.12%	1.07%	0.01%	0.61%	0.11%

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12月3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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
曾刚	汇添富多元收益、可转换债券、实业债债券、双利增强债券、汇添富安鑫智选混合、汇添富稳健添利定期开放债券基金、汇添富6月红定期开放债券基金、汇添富盈安保本混合基金、汇添富稳保本混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富长添利定期开放债券基金、汇添富鑫盈球基金、汇添富保鑫保本混合基金、汇添富长添利定期开放债券基金、汇添富年年益定开混合基金的基金经理,固定收益投资副总监。	2013年12月3日	-	16年	国籍:中国。学历:中国科技大学学士,清华大学MBA。业务资格:基金从业资格。从业经历:2008年5月15日至2010年2月5日任华富货币基金的基金经理,2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强基金的基金经理,2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报基金的基金经理。2011年11月加入汇添富基金,现任固定收益投资副总监。2012年5月9日至2014年1月21日任汇添富理财30天基金的基金经理,2012年6月12日至2014年1月21日任汇添富理财60天基金的基金经理,2012年9月18日至今任汇添富多元收益基金的基金经理,2012年10月18日至2014年9月17日任汇添富理财28天基金的基金经理,2013年1月24日至2015年3月31日任汇添富理财21天基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理,2013年5月29日至2015年3月31日任汇添富理财7天基金的基金经理,2013年6月14日至今任汇添富实业债基金的基金经理,2013年9月12至2015年3月31日任汇添富现金宝货币基金的基金经理,2013年12月3日至今任汇添富双利增强债券基金的基金经理,2015年11月26日至今任汇添富安鑫智选混合基金的基金经理,2016年2月17日至今任汇添富6月红定期开放债券基金的基金经理,2016年3月16日至今任汇添富稳健添利定期开放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,2016年12月6日至今任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理,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,国内经济形势仍然较为乐观,与上半年受益于补库存和供给侧改革不同,三季度投资、出口和消费均有起伏,数据并不算强劲,但经济结构上的改善,叠加环保限产等因素的影响,总体经济数据仍体现出较强的韧性。三季度,在美元指数大幅走弱的情况下,人民币对美元明显升值,央行具备更有利的条件推进去杠杆的监管政策,前三季度的公开市场操作主要是维持流动性基本稳定的紧平衡,分类分层监管的细则拉开了资金成本,促使金融产品加快去杠杆。从利率债走势看,7月收益率曲线略微陡峭化,之后资金面重回紧张,曲线再度平坦化。信用债部分,7月份收益率阶段性见底,到8月中下旬市场情绪趋紧,分歧加大,一级市场密集取消发行,9月份,央行实施精准操作,维护市场流动性,收益率小幅下行,但成交并不活跃。总体而言,三季度债市震荡中小幅调整,市场较为弱势,中债总指数仅上涨0.3%。

在上半年股市结构性行情的基础上,投资者的参与心态逐渐积极,一方面港股和海外股市的积极走势,推动国内投资者进一步认握价值投资理念,另一方面新能源车、通信、AI等科技类主题也出现了一批支持者,总体走势较强,股票指数涨幅在5%左右,市场热度继续抬升,且风格适度分化。中证转债指数上涨4.3%,主要的涨幅发生在7月份,9月份在估值较高和新债供应量较大的情况下,有所回落,且成交减少。

本组合三季度净值上涨近1.7%,纯债配置保持较低久期,股票部分围绕蓝筹股展开,节奏上调整较为积极,取得了较好的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富双利增强债券A基金份额净值为1.047元,本报告期基金份额净值增长率为1.69%;截至本报告期末汇添富双利增强债券C基金份额净值为1.055元,本报告期基金份额净值增长率为1.68%;同期业绩比较基准收益率为1.07%。

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	55,532,266.04	7.41
	其中:股票	55,532,266.04	7.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	656,263,143.80	87.56
	其中:债券	656,263,143.80	87.56
	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	22,000,000.00	2.94
	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	5,344,296.40	0.71
8	其他资产	10,399,432.48	1.39
9	合计	749,539,138.72	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	20,599,486.04	2.75
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	2,317,100.00	0.31
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	2,816,320.00	0.38
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	29,799,360.00	3.98
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	55,532,266.04	7.42

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	601888	中国国旅	864,000	29,799,360.00	3.98
2	002507	涪陵榨菜	899,920	13,381,810.40	1.79
3	600519	贵州茅台	7,201	3,727,525.64	0.50
4	002236	大华股份	145,000	3,490,150.00	0.47
5	601318	中国平安	52,000	2,816,320.00	0.38
6	601933	永辉超市	290,000	2,317,100.00	0.31

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	499,750.00	0.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,876,000.00	5.33
	其中:政策性金融债	39,876,000.00	5.33
4	企业债券	321,522,862.90	42.95
5	企业短期融资券	281,022,000.00	37.54
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	13,342,530.90	1.78
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	656,263,143.80	87.67

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	011771003	17首钢SCP002	500,000	50,225,000.00	6.71
2	041653066	16首机场股CP001	500,000	50,200,000.00	6.71
3	011751051	17光明ISCP002	500,000	50,155,000.00	6.70
4	011756033	17大唐集SCP005	500,000	50,105,000.00	6.69
5	136515	16硫浚02	500,000	48,670,000.00	6.50

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

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	87,749.78
2	应收证券清算款	39,208.22
3	应收股利	-
4	应收利息	10,270,494.28
5	应收申购款	1,980.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,399,432.48

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	113010	江南转债	5,284,000.00	0.71

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不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富双利增强债券A	汇添富双利增强债券C
报告期期初基金份额总额	179,751,365.04	2,472,571.13
报告期期间基金总申购份额	2,359,351,450.40	521,139.89
减:报告期期间基金总赎回份额	1,825,677,328.33	1,679,493.03
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	713,425,487.11	1,314,217.99

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 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2017年8月11日至2017年8月15日	-	384,614,615.38	280,000,000.00	104,614,615.38	14.64%
	2	2017年8月11日至2017年8月14日,2017年9月13日至2017年9月30日	-	336,537,500.00	-	336,537,500.00	47.09%
	3	2017年8月31日至2017年9月18日	-	423,075,384.61	423,075,384.61	0.00	-
	4	2017年9月13日至2017年9月18日	-	307,690,769.23	307,690,769.23	0.00	-
	5	2017年9月19日至2017年9月30日	-	259,999,230.77	-	259,999,230.77	36.38%
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双利增强债券型证券投资基金募集的文件;

2.《汇添富双利增强债券型证券投资基金基金合同》;

3.《汇添富双利增强债券型证券投资基金托管协议》;

4.《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》;

5.基金管理人业务资格批件、营业执照;

6.报告期内双利增强债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;

7.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

汇添富外延增长主题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	汇添富外延增长股票
交易代码	000925
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月8日
报告期末基金份额总额	3,319,416,185.13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,精选外延增长主题股票,重点挖掘外延式增长的投资机会,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	本基金为股票型基金,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通过并购重组活动实现企业外延式增长的上市公司。
业绩比较基准	沪深300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	128,210,049.54
2.本期利润	702,647,078.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.2128
4.期末基金资产净值	4,450,768,027.48
5.期末基金份额净值	1.341

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。

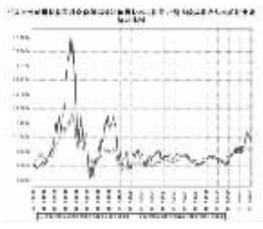
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	19.09%	1.58%	3.67%	0.47%	15.42%	1.11%

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(2014年12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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
韩贤旺	汇添富外延增长主题股票基金、汇添富全球移动互联混合基金的基金经理,首席经济学家。	2014年12月8日	-	19年	国籍:中国。学历:复旦大学经济学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任君安证券有限责任公司分析师、大同证券有限责任公司研究所所长助理、行业部经理、国联安基金管理有限公司研究主管、平安资产管理有限公司股票研究主管。2007年5月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任首席经济学家,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,2014年12月8日至今任汇添富外延增长股票基金的基金经理,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。
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1月29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。

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

三季度经济数据整体有所下行,特别是8月受环保督查影响,主要经济指标全面低于预期,相对而言,受环保督查影响不大的地区投资和工业生产指标下降并不明显,说明实际经济表现应该好于官方披露的数据,经济短期韧性仍较好。三季度工业品价格指数受环保督查影响出现明显反弹,尽管消费物价指数保持平稳,但通胀压力有所抬升。三季度货币政策整体保持偏紧局面,超储率总体保持在1%的低位水平徘徊,资金利率尽管季初一度走低,但整体持续居高不下,尤其9月末资金利率大幅攀升明显超预期。三季度债券市场收益率整体震荡上行,季初在高估值和资金面短暂宽松下,收益率曲线陡峭化下行,但随后资金面再度紧张,收益率曲线再度平坦化上行,上行幅度多数在10-20BP附近,信用利差较二季度末变化不大。

三季度,本组合操作上相对灵活,前期保持二季度末的较高仓位债券水平,但在后期组合适度降低了债券仓位,杠杆比例和组合久期都较二季度末有所降低;三季度组合适度增加了转债的持仓比例。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金 A 级份额增长率为0.40%,C 级份额增长率为0.30%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金已连续60个工作日基金份额持有人数量不满二百人,根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定,本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§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	618,958,973.10	94.51
	其中:债券	618,958,973.10	94.51
	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	26,384,688.70	4.03
8	其他资产	9,547,378.17	1.46
9	合计	654,891,039.97	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	51,589,793.60	1.16
C	制造业	3,998,460,357.69	89.84
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	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	65,832,468.03	1.48
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	115,299.99	0.00
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,116,124,970.61	92.48

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通过沪港通和深港通投资的股票。

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	603799	华友钴业	4,699,975	429,906,713.25	9.66
2	002460	赣锋锂业	4,800,000	419,040,000.00	9.42
3	002466	天齐锂业	5,491,000	385,962,390.00	8.67
4	300450	先导智能	5,000,067	373,004,998.20	8.38
5	002236	大华股份	13,499,955	324,943,916.85	7.30
6	002384	东山精密	9,883,198	283,845,446.56	6.38
7	300136	信维通信	6,600,000	277,200,000.00	6.23
8	300340	科恒股份	3,900,771	251,950,798.89	5.66
9	002635	安洁科技	5,301,402	215,555,005.32	4.84
10	002475	立讯精密	10,000,000	206,600,000.00	4.64

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:本基金本报告期内未投资股指期货。

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	1,225,928.27
2	应收证券清算款	44,104.40
3	应收股利	-
4	应收利息	68,797.47
5	应收申购款	19,230,502.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,569,332.23

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300340	科恒股份	251,950,798.89	5.66	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,374,813,823.72
报告期期间基金总申购份额	370,394,800.18
减:报告期期间基金总赎回份额	425,792,438.77
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	3,319,416,185.13

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外延增长主题股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富外延增长主题股票型证券投资基金合同》;

3、《汇添富外延增长主题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、报告期内汇添富外延增长主题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

汇添富稳健添利定期开放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。