汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金

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	添富沪港深优势定开
基金主代码	006205
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年9月21日
报告期末基金份额总额	217,758,457.39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,在科学严格管理风险的前提下,精选优质个股,为基金份额持有人谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金。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股票市场中具有核心竞争优势和长期持续增长模式的上市公司。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*15%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*65%+中债综合财富指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险收益水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中等收益/风险特征的基金。 本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
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(2019年4月1日－2019年6月30日)
1.本期已实现收益	11,461,877.50
2.本期利润	5,483,626.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0252
4.期末基金资产净值	238,449,299.15
5.期末基金份额净值	1.0950

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。

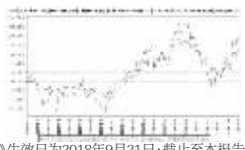
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.36%	1.21%	0.53%	0.77%	1.83%	0.44%

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》生效日为2018年9月21日;截止至本报告期末,基金成立未满1年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2018年9月21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		
陈健玮	添富沪港深大盘价值混合、添富沪港深优势定开的基金经理	2018年9月21日	－	9年	国籍:中国香港;学历:香港大学土木工程学士,中欧国际工商学院工商管理硕士（MBA）。相关从业资格：证券投资基金从业资格。曾任德勤·关黄陈方会计师行（香港）环球金融服务组审计师，国投瑞银基金管理有限公司国际业务部研究员、投资经理助理、投资经理,博时基金管理有限公司投资经理。2017年4月加入汇添富基金管理股份有限公司,2018年2月13日至今任添富沪港深大盘价值混合的基金经理,2018年9月21日至今任添富沪港深优势定开的基金经理。

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

回顾二季度,港股市场在经历完一季度的反弹后出现了回调,恒生指数在4月份创出了今年的新高,但5–6月份由于受到贸易摩擦恶化的影响,市场出现了较大的跌幅和波动。国际形势方面,中美贸易摩擦的担忧在5月重燃,美国不单对我国进口商品再次提高关税,并把华为放在实体清单,导致避险情绪上升。另一方面,美联储今年以来总体基调偏鸽派,市场的预期从去年底的加息预期已逐步调整为降息预期。国内方面,中央对于经济和金融系统稳定的重视程度仍然较高,并强调对民营经济的支持,在适度宽松的货币政策和积极的财政政策支持下,宏观经济有望逐步企稳,结构升级转型也在持续进行。行业方面,二季度中必选消费和公用事业表现出较强的防御特征,而能源和资讯科技板块表现较弱。

操作方面,本基金在二季度保持着较为平稳的仓位,并维持“行业相对均衡、个股适度集中、适时动态调整”的思路。本基金的配置方面以具有长期竞争优势的龙头企业为主,在目前宏观经济的换挡期中,将有利于该行业中的龙头企业获得市场份额和长期盈利的提升，我们对于优质的中国企业的长期盈利前景较有信心，因此认为港股市场中的优秀上市企业仍然存在中长期估值修复和扩张的机会。本基金注重行业的均衡配置,目前以目前以金融和消费为核心板块,并适当配置房地产、资讯科技、公用事业、工业等板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末添富沪港深优势定开基金份额净值为1.0950元,本报告期基金份额净值增长率为2.36%;同期业绩比较基准收益率为10.53%。

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	217,767,006.63	89.39
	其中:股票	217,767,006.63	89.39
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	22,286,339.38	9.15
8	其他资产	3,569,777.29	1.46
9	合计	243,623,123.30	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境内股票投资。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	12,712,142.59	5.33
B 消费者非必需品	46,049,413.71	19.31
C 消费者常用品	－	－
D 能源	－	－
E 金融	48,137,484.64	20.19
F 医疗保健	－	－
G 工业	36,541,604.19	15.32
H 信息技术	9,448,867.89	3.96
I 电信服务	16,438,910.15	6.89
J 公用事业	17,072,810.74	7.16
K 房地产	31,365,772.72	13.15
合计	217,767,006.63	91.31

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	00700	腾讯控股	53,000	16,438,910.15	6.89
2	00813	世茂房地产	766,500	16,047,373.48	6.73
3	01169	海尔电器	707,000	13,433,463.79	5.63
4	00586	海螺创业	553,000	13,426,074.65	5.63
5	01114	BRIL–LIANCECHI	1,608,000	12,221,221.94	5.13
6	06886	HTSC	946,000	11,184,208.36	4.69
7	02601	中国太保	388,600	10,443,086.01	4.38
8	01109	华润置地	338,000	10,227,982.75	4.29
9	002285	比亚迪电子	962,500	9,448,867.89	3.96
10	01313	华润水泥控股	1,400,000	9,322,636.68	3.91

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投资组合。

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投资组合。

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:本基金报告期内未持有国债期货。

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	940,600.82
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	2,625,560.13
4	应收利息	3,616.34
5	应收申购款	－
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	3,569,777.29

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	217,758,457.39
报告期期间基金总申购份额	－
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	217,758,457.39

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

注:无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富沪港深优势精选定期开放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、报告期内汇添富沪港深优势精选定期开放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

汇添富理财60天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。

汇添富理财60天债券型证券投资基金于2019年04月18日起取消自动升降级业务，并调整估值方法、收益分配模式和投资组合限制。涉及本基金投资范围、投资限制、申购和赎回价格、估值方法、收益分配、信息披露等内容按照修订后的《基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项,本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续。

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。其中,2019年4月18日起,取消自动升降级业务,并调整估值方法、收益分配模式和投资组合限制。修订后的《基金合同》即日生效。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富理财60天债券
基金主代码	470060
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年4月18日
报告期末基金份额总额	1,242,798,509.81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	将采用积极管理型的投资策略,原则上将投资组合的平均剩余期限控制在180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	本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场型证券投资基金。
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
下属分级基金的基金简称	汇添富理财60天债券A　汇添富理财60天债券B　汇添富理财60天债券E
下属分级基金的交易代码	470060　471060　005603
报告期末下属分级基金的份额总额	191,947,765.35份　39,264,666.55份　1,011,586,077.91份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	汇添富理财60天债券
基金主代码	470060
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月12日
报告期末基金份额总额	1,751,442,154.98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	将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在180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	本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场型证券投资基金。
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
下属分级基金的基金简称	汇添富理财60天债券A　汇添富理财60天债券B　汇添富理财60天债券E
下属分级基金的交易代码	470060　471060　005603
报告期末下属分级基金的份额总额	237,869,222.85份　136,913,628.99份　1,376,659,303.14份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月18日－2019年6月30日)		
	汇添富理财60天债券A	汇添富理财60天债券B	汇添富理财60天债券E
1.本期已实现收益	1,077,395.45	250,243.67	6,164,269.74
2.本期利润	1,450,249.07	474,875.82	8,293,540.86
3 加权平均基金份额本期利润	0.0068	0.0107	0.0073
4.期末基金资产净值	193,234,175.53	39,572,228.74	1,018,681,757.32
5.期末基金份额净值	1.0067	1.0078	1.0070

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、汇添富理财60天债券型证券投资基金于2019年04月18日起取消自动升降级业务,并调整估值方法、收益分配模式和投资组合限制。修订后的《基金合同》即日生效。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日－2019年4月17日)	报告期(2019年4月1日－2019年4月17日)	报告期(2019年4月1日－2019年4月17日)
	汇添富理财60天债券A	汇添富理财60天债券B	汇添富理财60天债券E
1.本期已实现收益	250,644.98	286,783.36	1,546,869.29
2.本期利润	250,644.98	286,783.36	1,546,869.29
3.期末基金资产净值	237,869,222.85	136,913,628.99	1,376,659,303.14

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（转型后）

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

汇添富理财60天债券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（2019年4月18日至2019年6月30日）	0.67%	0.03%	0.27%	0.00%	0.40%	0.03%

汇添富理财60天债券B

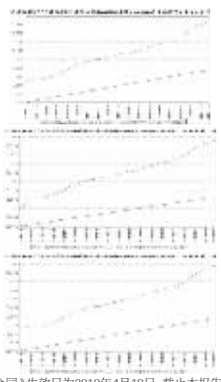
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月（2019年4月18日至2019年6月30日）	0.78%	0.03%	0.27%	0.00%	0.51%	0.03%

汇添富理财60天债券E

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（2019年4月18日至2019年6月30日）	0.70%	0.03%	0.27%	0.00%	0.43%	0.03%

注: 本基金的《基金合同》生效日为2019年4月18日,截止本报告期末,基金成立未满一年。

3.2.2 自基金转型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:1、本基金的《基金合同》生效日为2019年4月18日,截止本报告期末,基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2019年4月18日）起6个月,截止本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

汇添富理财60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（2019年4月1日至2019年4月17日）	0.0997%	0.0017%	0.0629%	0.0000%	0.0368%	0.0017%

汇添富理财60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（2019年4月1日至2019年4月17日）	0.1133%	0.0017%	0.0629%	0.0000%	0.0504%	0.0017%

汇添富理财60天债券E

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（2019年4月1日至2019年4月17日）	0.1067%	0.0017%	0.0629%	0.0000%	0.0438%	0.0017%

注: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:1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2012年6月12日）起五日,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

2、本基金自2017年12月21日起增设E类份额,份额申购首次确认日为2017年12月22日。

§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		
徐寅喆	汇添富和聚宝货币基金、汇添富理财7天债券基金、汇添富货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金、汇添富添富通货币基金的基金经理。	2018年5月4日	－	11年	国籍:中国。学历:复旦大学法学学士。曾任长江养老保险股份有限公司债券交易员。2012年5月加入汇添富基金管理股份有限公司任债券交易员、固定收益基金经理助理。2014年8月27日至今任汇添富理财7天债券型证券投资基金的基金经理,2014年11月27日至2018年5月4日任汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理,2014年11月26日至今任汇添富和聚宝货币市场基金经理,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基金经理,2016年6月7日至2018年5月4日任汇添富全额宝货币基金的基金经理,2018年5月4日至今任汇添富货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金的基金经理,2019年1月25日至今任汇添富添富通货币基金的基金经理。

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

今年二季度中美经贸关系波诡云谲,经历了加征关税威胁,遭遇了对华为公司的禁令,最终两国重启经贸磋商,市场情绪受此影响,风险偏好忽上忽下。海外方面,美债收益率曲线出现倒挂,美国经济下行风险有所增加,市场预期美联储今年晚些时候进行降息的概率显著提高。国内方面,经济面临一定的下行压力,制造业PMI连续两个月位于荣枯线下方,实体经济呈现出供需同时走弱的特征。在出口面临关税影响,房地产企业融资环境收紧的压制下,以基建为代表的逆周期调节政策有所发力,但其效果尚需时日。货币政策方面,货币政策继续强调松紧适度,保持广义货币M2和社会融资规模增速与国内生产总值名义增速相匹配。金融监管方面,金融风险防控稳妥推进,把握好处置风险的力度和节奏。操作上为避免风险传导扩大,央行积极在公开市场投放资金,其他监管主体联合行动,引导头部券商向非银机构积极融出资金维护市场稳定。

二季度银行间流动性延续宽松态势,6月下旬流动性更是十分充裕,DR001回购加权价格创下新低。短期限资产方面,收益率经历了先上后下的走势。以3M国股存存单为代表的短期收益率在2.45%到3.0%之间。基金操作方面,适当增加了短融的买入,维持组合的有效债券仓位,采取稳健的投资思路,保持较低的杠杆水平和投资高等级债券。

4.5 报告期内基金的业绩表现

自2019年4月18日本基金转型成立后，汇添富理财60天债券A的基金份额净值收益率为0.67%,汇添富理财60天债券B的基金份额净值收益率为0.78%,汇添富理财60天债券E的基金份额净值收益率为0.70%,同期业绩比较基准收益率为0.27%。

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（转型后）

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	1,190,437,000.00	91.76
	其中:债券	1,170,437,000.00	90.21
	资产支持证券	20,000,000.00	1.54
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	91,095,590.26	7.02
8	其他资产	15,864,047.01	1.22
9	合计	1,297,396,637.27	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	359,860,000.00	28.75
	其中:政策性金融债	359,860,000.00	28.75
4	企业债券	19,998,000.00	1.60
5	企业短期融资券	741,839,000.00	59.28
6	中期票据	－	－
7	可转债（可交换债）	－	－
8	同业存单	48,740,000.00	3.89
9	其他	－	－
10	合计	1,170,437,000.00	93.52

注:本报告期内本货币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	－	－
2	央行票据	－	－
3	金融债券	359,910,952.77	20.55
	其中:政策性金融债	359,910,952.77	20.55
4	企业债券	20,028,419.71	1.14
5	企业短期融资券	709,828,735.33	40.53
6	中期票据	262,564,363.82	14.99
7	同业存单	99,132,389.15	5.66
－	－	－	－
9	其他	－	－
10	合计	1,451,464,860.78	82.87
11	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	190201	19国开01	1,600,000	159,890,288.71	9.13
2	180209	18国开09	1,100,000	110,106,951.06	6.29
3	101451016	14中海油MTN001	1,000,000	100,973,031.97	5.77
4	101461014	14苏交通MTN002	1,000,000	100,827,183.14	5.76
5	011801562	18国电SCP007	1,000,000	100,300,902.06	5.73
6	011802182	18招商局SCP008	1,000,000	100,127,253.94	5.72
7	071900021	19国泰君安CP002	1,000,000	99,409,593.01	5.68
8	011900396	19中电信SCP003	700,000	69,891,555.96	3.99
9	101456044	14渝富MTN001	600,000	60,764,148.71	3.47
10	041800243	18电网SCP001	500,000	50,409,870.27	2.88

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	－
报告期内偏离度的最高值	0.1713%
报告期内偏离度的最低值	0.1271%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1584%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:本报告期内,本基金未发生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: 本报告期内,本基金未发生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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,724.79
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	32,629,331.26
4	应收申购款	－
5	其他应收款	－
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	32,631,056.05

§6 开放式基金份额变动（转型后）

单位:份

项目	汇添富理财60天债券A	汇添富理财60天债券B	汇添富理财60天债券E
基金合同生效日（2019年4月18日）持有的基金份额	237,869,222.85	136,913,628.99	1,376,659,303.14
报告期期间基金总申购份额	5,316,885.77	5,509,610.60	129,898,481.04
减:报告期期间基金总赎回份额	51,238,343.27	103,158,573.04	494,971,706.27
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	191,947,765.35	39,264,666.55	1,011,586,077.91

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。

§6 开放式基金份额变动（转型前）

单位:份

项目	汇添富理财60天债券A	汇添富理财60天债券B	汇添富理财60天债券E
报告期期初基金份额总额	257,529,517.47	272,712,557.84	1,492,214,963.83
报告期期间基金总申购份额	427,315.19	139,282.45	1,264,802.88
报告期期间基金总赎回份额	20,087,609.81	135,938,211.30	116,820,463.57
报告期期末基金份额总额	237,869,222.85	136,913,628.99	1,376,659,303.14

注:总申购份