汇添富添富通货币市场基金

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	汇添富添富通货币		
基金主代码	000366		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年1月16日		
报告期末基金份额总额	4,659,887,108.92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、混合型基金和债券型基金。		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	汇添富添富通货币A	汇添富添富通货币B	汇添富添富通货币E
下属分级基金的场内简称	-	-	现金添富
下属分级基金的交易代码	000366	000980	511980
报告期末下属分级基金的份额总额	3,335,029,690.63份	1,322,606,939.63份	2,250,478.66份

注:1、汇添富添富通货币市场基金E类合同生效日为2015年10月16日;
2、汇添富添富通货币市场基金E类份额上市交易;
3、本基金A类、B类份额面值为人民币1元,E类份额面值为人民币100元。

§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)	报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)	报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)
	汇添富添富通货币A	汇添富添富通货币B	汇添富添富通货币E
1. 本期已实现收益	20,780,014.60	13,515,397.81	1,556,445.23
2. 本期利润	20,780,014.60	13,515,397.81	1,556,445.23
3. 期末基金资产净值	3,335,029,690.63	1,322,606,939.63	225,047,865.61

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。由于货币市场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。

2、本基金收益分配按日结转份额。

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

汇添富添富通货币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	0.6199%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.5326%	0.0004%

汇添富添富通货币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	0.6801%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.5928%	0.0004%

汇添富添富通货币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	0.6138%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.5265%	0.0004%

注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2015年1月16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。自2015年10月16日起,本基金增设E类份额类别,份额申购首次确认日为2015年10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		
温开强	汇添富理财30天债券、汇添富添富通货币、汇添富货币、汇添富理财7天债券的基金经理,汇添富民金宝货币、汇添富理财14天债券、汇添富理财60天债券基金的基金经理助理	2019年1月25日	-	7年	国籍:中国,学历:天津大学管理学硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格,CFA、从业经历:曾任长城基金债券交易员、中金基金交易主管,高级经理,2016年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,2016年8月30日至今任汇添富民金宝货币、汇添富理财14天债券、汇添富理财60天债券基金的基金经理助理,2016年8月30日至2019年1月25日任汇添富添富通货币、汇添富货币的基金经理助理,2016年8月30日至2018年8月7日任汇添富理财30天债券的基金经理助理,2018年8月7日至今任汇添富理财30天债券的基金经理,2019年1月25日至今任汇添富添富通货币、汇添富货币、汇添富理财7天债券的基金经理。
徐爽喆	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	2019年1月25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8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22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,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

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。临近季末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国股行存单为代表的短期收益率在2.45%到3.0%之间。本基金在二季度操作上保持稳健的投资策略,报告期内以高等级银行存款、高等级同业存单、逆回购为主要配置资产,适度增加高等级信用债及利率债的配置仓位,辅以积极的波段操作增厚组合收益、积累组合偏离度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富添富通货币A的基金份额净值收益率为0.6199%,本报告期汇添富添富通货币B的基金份额净值收益率为0.6801%,本报告期汇添富添富通货币E的基金份额净值收益率为0.6138%,同期业绩比较基准收益率为0.0873%。

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	1,626,647,715.04	30.95
	其中:债券	1,626,647,715.04	30.95
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,219,500,684.25	23.20
	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	2,178,108,276.33	41.44
4	其他资产	231,338,174.26	4.40
5	合计	5,255,594,849.88	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.50
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	369,999,215.00	7.58
	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:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	59
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	75
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:报告期内投资组合平均剩余期限无超过120天情况。

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	49.37	7.58
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	27.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	8.69	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	2.03	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	19.42	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		107.03	7.58

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	401,745,902.12	8.23
	其中:政策性金融债	401,745,902.12	8.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,224,901,812.92	25.09
8	其他	-	-
9	合计	1,626,647,715.04	33.31
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	190402	19农发02	1,100,000	109,763,093.25	2.25
2	180202	18国开02	1,000,000	101,143,318.37	2.07
3	170205	17国开05	1,000,000	100,828,025.36	2.07
4	111815346	18民生银行CD346	1,000,000	99,887,055.66	2.05
4	111806178	18交通银行CD178	1,000,000	99,887,055.66	2.05
5	111808265	18中信银行CD265	1,000,000	99,849,361.30	2.04
6	111810508	18兴业银行CD508	1,000,000	99,843,067.31	2.04
7	111809351	18浦发银行CD351	1,000,000	99,825,912.29	2.04
8	111981285	19广州农村商业银行CD084	1,000,000	99,811,318.07	2.04
9	111881892	18成都银行CD193	1,000,000	99,627,391.71	2.04

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	0.0793%
报告期内偏离度的最低值	0.0030%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0296%

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%的情况。

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%的情况。

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:本基金本报告期末无资产支持证券持仓。

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	-
2	应收证券清算款	201,495,000.00
3	应收利息	29,396,877.94
4	应收申购款	447,296.32
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	231,338,174.26

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富添富通货币A	汇添富添富通货币B	汇添富添富通货币E
报告期期初基金份额总额	2,935,189,800.76	2,224,414,474.28	2,660,688.20
报告期期间基金总申购份额	18,037,688,370.81	628,265,397.81	15,564.46
报告期期间基金总赎回份额	17,637,848,480.94	1,530,072,932.46	425,774.00
报告期期末基金份额总额	3,335,029,690.63	1,322,606,939.63	2,250,478.66

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。本基金E类合同生效日为2015年10月16日,基金份额面值为人民币100元,本报告期的相关数据按实际存续期计算

§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

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新收益债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富添富通货币市场基金基金合同》;

3、《汇添富添富通货币市场基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、报告期内汇添富添富通货币市场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

汇添富稳健添利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	汇添富稳添利定期开放债券	
基金主代码	002487	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年3月16日	
报告期末基金份额总额	50,262,470.04份	
投资目标	在追求本金安全的基础上,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	
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	汇添富稳添利定期开放债券A	汇添富稳添利定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	002487	002488
报告期末下属分级基金的份额总额	50,167,378.15份	95,091.89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)	
	汇添富稳添利定期开放债券A	汇添富稳添利定期开放债券C
1.本期已实现收益	660,630.29	1,153.05
2.本期利润	-72,141.31	-256.26
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0014	-0.0027
4.期末基金资产净值	53,007,050.15	99,254.07
5.期末基金份额净值	1.057	1.044

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

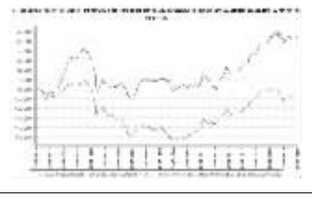
汇添富稳添利定期开放债券A

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	-0.09%	0.08%	-0.24%	0.06%	0.15%	0.02%

汇添富稳添利定期开放债券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	-0.19%	0.09%	-0.24%	0.06%	0.05%	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(2016年3月16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		
管刚	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、汇添富盈稳保本混合基金、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、添富年年益定开混合基金、添富熙和混合基金、汇添富达欣混合基金的基金经理,现金管理部总经理。	2016年3月16日	-	18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,2018年2月11日至今任添富熙和混合基金的基金经理,2018年7月6日至今任汇添富达欣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

由于担忧宏观经济疲软而引起可选消费品的消费需求减少,文体娱乐基金在12月建仓期结束后,一直维持了低仓位,导致在1-2月快速反弹过程中业绩表现明显落后于市场。从实际的微观企业表现来看,中国的消费品市场保持了非常强的需求韧性,特别是消费者对美好生活的追求,使得可选消费品在本轮宏观下行周期表现超预期的好,高端白酒、化妆品、体育用品、健康保健品及服务、休闲娱乐产品及服务等领域的龙头企业表现都较为强劲。

文体娱乐基金从3月开始,仓位增加至较高水平,而资产配置并未发生重大变化,主要投资脉络仍然是与中国消费者的精神需求、娱乐需求紧密相关的可选消费品,其中包括高端白酒、化妆品、体育用品、健康保健品及服务、休闲娱乐产品及服务、文教用品及服务、餐饮等生活服务、企业级服务等。

尽管与精神需求、娱乐需求相关的可选消费品将中长期保持结构性增长,但由于其可选属性,在渠道力、品牌力、产品力等方面不具备持续性竞争优势的企业,很容易形成"一代拳王"。我们努力寻找行业中具备良好企业治理、有中长期持续经营能力的龙头企业进行布局,二季度我们进一步优化了组合中的股票质量。

2019年4月1日至6月28日,文体娱乐基金上涨7.1%,同期恒生指数下跌1.8%、上证综指下跌3.6%、深证成指下跌7.4%、沪深300下跌1.2%、中小板指下跌11%、创业板指下跌10.8%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富文体娱乐混合基金份额净值为1.2545元,本报告期基金份额净值增长率为7.08%;同期业绩比较基准收益率为-8.06%。

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	59,793,202.00	97.16
	其中:债券	59,793,202.00	97.16
	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	753,776.98	1.22
8	其他资产	992,382.15	1.61
9	合计	61,539,361.13	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。

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

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	27,298,300.00	51.40
	其中:政策性金融债	10,751,000.00	20.24
4	企业债券	27,936,100.00	52.60
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	4,558,802.00	8.58
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,793,202.00	112.59

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	180205	18国开05	100,000	10,751,000.00	20.24
2	112232	14长证债	40,000	4,028,000.00	7.58
3	143327	17招商G1	40,000	4,019,200.00	7.57
4	136865	16新燃01	40,000	4,002,800.00	7.54
5	136826	16国网01	40,000	4,001,600.00	7.54

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投资。

5.9 报告期末本基金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:报告期末本基金无国债期货持仓。

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	582,910.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	175,166.80
4	应收利息	5,577.67
5	应收申购款	982,245.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,745,900.69

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不存在流通受限情况的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富稳添利定期开放债券A	汇添富稳添利定期开放债券C
报告期期初基金份额总额	50,207,682.72	100,093.20
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	40,304.57	5,001.31
报告期期末基金份额总额	50,167,378.15	95,091.89

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	50,000,000.00	0	0	50,000,000.00	99.48
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稳健添利定期开放债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富稳健添利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