汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3月31日

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4月20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4月18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1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富蓝筹稳健混合
基金主代码	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	1,856,540,635.28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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	85,465,038.77
2.本期利润	949,794,639.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.4740
4.期末基金资产净值	4,400,200,561.98
5.期末基金份额净值	2.370

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。

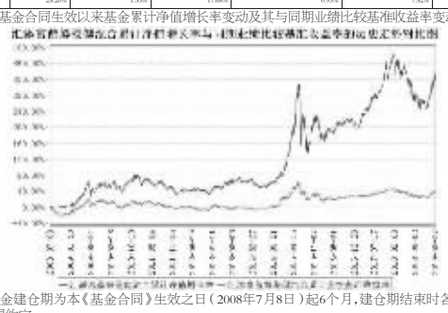
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	25.20%	1.33%	17.68%	0.93%	7.52%	0.40%

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		
雷鸣	汇添富成长焦点混合基金、汇添富蓝筹稳健混合、汇添富经典成长定开混合、汇添富社会责任混合的基金经理。	2015年1月6日	-	12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6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31至2017年6月30日任汇添富新兴消费股票基金的基金经理,2018年12月31日至今任汇添富经典成长定开混合基金的基金经理,2019年1月4日至今任汇添富社会责任混合的基金经理。

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、交易产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2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

2018年市场在极度悲观预期下持续大幅下跌后,进入2019年一季度市场强劲上涨。宏观层面稳增长政策不断落实叠加市场流动性大幅改善,微观层面企业盈利预期并没有想象中悲观,市场预期得以明显修正,估值水平大幅反弹。一季度沪深300指数上涨28.62%,上证综指上涨23.93%,创业板综指上涨33.43%,中小板综指上涨33.79%。报告期内延续自下而上精选个股策略,适时提高了组合仓位,组合结构更为均衡,着眼长期围绕公司中长期核心竞争优势进行布局。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金2019年第1季度实现收益率为25.20%,同期沪深300指数上涨28.62%。

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	3,338,191,070.45	73.11
	其中:股票	3,338,191,070.45	73.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	155,423,194.80	3.40
	其中:债券	155,423,194.80	3.40
	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	300,118,390.05	6.57
	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	705,240,719.08	15.45
8	其他资产	66,888,692.45	1.46
9	合计	4,565,862,066.83	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	1,563,670,326.57	35.54
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	3,298,510.04	0.07
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	12,074,790.00	0.27
J	金融业	1,009,347,496.66	22.94
K	房地产业	42,750,000.00	0.97
L	租赁和商务服务业	612,572,532.00	13.92
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	94,477,425.18	2.15
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,338,191,070.45	75.86

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投资股票投资。

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	002127	南极电商	37,890,000	433,840,500.00	9.86
2	601318	中国平安	5,500,000	424,050,000.00	9.64
3	000858	五粮液	4,000,076	380,007,220.00	8.64
4	000651	格力电器	6,500,062	306,867,927.02	6.97
5	600036	招商银行	8,000,000	271,360,000.00	6.17
6	000786	北新建材	12,000,016	241,800,322.40	5.50
7	601888	中国国旅	2,550,400	178,732,032.00	4.06
8	002597	招商榕基	5,266,300	163,360,626.00	3.71
9	601166	兴业银行	8,500,093	154,446,689.81	3.51
10	600031	三一重工	10,000,089	127,801,137.42	2.90

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)	155,423,194.80	3.53
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	155,423,194.80	3.53

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	132005	15国资EB	1,242,110	143,215,283.00	3.25
2	128029	太阳转债	111,082	12,207,911.80	0.28

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	1,009,963.93
2	应收证券清算款	61,989,283.89
3	应收股利	-
4	应收利息	797,626.35
5	应收申购款	3,101,818.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,888,692.45

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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	132005	15国资EB	143,215,283.00	3.25
2	128029	太阳转债	12,207,911.80	0.28

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	2,031,362,455.16
报告期期间基金总申购份额	149,817,190.39
减:报告期期间基金总赎回份额	324,639,010.27
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	1,856,540,635.28

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	-
报告期末管理人持有的本基金份额	5,207,812.50
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.28

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4月20日

汇添富理财7天债券型证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3月31日

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4月20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4月18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1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富理财7天债券	
基金主代码	471007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年5月29日	
报告期末基金份额总额	16,100,158,980.90份	
投资目标	本基金在追求本金安全,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	本基金将采用积极管理的投资策略,将投资组合的平均剩余期控制在127天内,在控制利率风险的,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7天债券A	汇添富理财7天债券B
下属分级基金的交易代码	471007	472007
报告期末下属分级基金的份额总额	131,075,887.00份	15,969,080,093.90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1月1日 - 2019年3月31日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B
1.本期已实现收益	1,040,357.63	122,944,863.37
2.本期利润	1,040,357.63	122,944,863.37
3.期末基金资产净值	131,075,887.00	15,969,080,093.90

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。

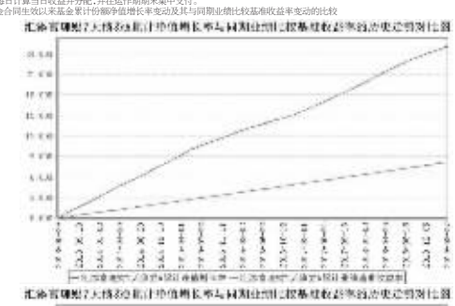
3.2 基金净值表现

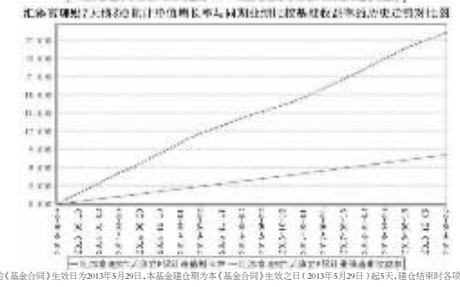
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富理财7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	0.6653%	0.0004%	0.3329%	0.0000%	0.3324%	0.0004%
汇添富理财7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	0.7750%	0.0004%	0.3329%	0.0000%	0.4421%	0.0004%

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份额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:本基金的《基金合同》生效日为2013年5月29日,本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年5月29日)起5天,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		
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天债券基金经理、汇添富理财7天债券B基金经理、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日至今任汇添富现金宝货币、汇添富理财14天债券、汇添富理财30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天债券基金基金经理助理,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。
徐震超	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天债券基金、汇添富现金宝货币、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	2014年8月27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,2014年8月27日至今任汇添富理财30天债券基金基金经理,2014年8月27日至2018年5月14日任汇添富现金宝货币、汇添富理财14天债券基金、汇添富理财60天债券基金基金经理,2018年5月14日至今任汇添富现金宝货币、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、汇添富货币、汇添富理财7天债券的基金经理。

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、交易产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成交量5%的交易次数为2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

今年一季度宏观形势出现转折,积极因素增多,市场预期出现显著反转。中美贸易双方的谈判正紧锣密鼓地推进,美联储已停止了加息步伐。尽管从PMI等数据方面分析,经济仍面临一定下行压力,但整体可控。需要注意的是,今年1月新增社会融资规模4.64万亿,显著超出市场预期;2月又回落至7030亿,不及市场预期。结合这2个月的数据情况,社会融资的大幅波动与票据融资密切相关,仍需密切关注后续社会融资的变化和结构。今年三月初政府工作报告对2019年经济增长的目标设定为运行区间,从去年的"6.5%左右"调整成"6%-6.5%",重视守住经济增长的底线,同时也为经济从高增长转向高质量增长创造空间。为积极应对经济下行压力,政策层面进行有效调整,财政政策提出要加力提效,尽管赤字率上调至2.8%,低于市场预期的3%,但地方专项债券加大了8000亿的发行供给,并且从两会前就启动了发行。同时,今年减税降费的目标规模是2万亿,较去年有明显的增长,总理三令五申强调做好企业减负工作。货币政策继续强调松紧适度,但不再提及中性,重点放在了疏通货币传导机制和化解实体融资困难上。货币政策操作工具提及了利率工具的运用,引导降低实际利率。对M2和社会融资的增速提出要与名义GDP增速相匹配。监管政策方面,对于经济风险方面提到保持宏观杠杆基本稳定和金融财政风险的有效防控。房地产政策的落实责任由城市主体根据实际情况进行,即"因城施策"。

一季度银行间流动性延续了宽松态势。尽管期间面临传统春节和一季末等关键时点,但市场总体是非常平稳的。此外,银行间市场的资金价格相对于短期资产而言维持在了一个较高的水平,以R.007回购价格为例,一季度其整体在2.6%-3.0%之间波动。短期限资产方面,收益率在区间内小幅震荡,以3M国股存单为代表的短期收益率在2.6%到3.0%之间。本基金考虑组合面临新的监管要求和规模变化特点,在基金操作方面,报告期内以银行存款和同业存单为主要配置资产,同时积极增加了短融、超短融等信用债的配置比例。根据当前市场收益率的水平和融资成本,采取较为稳健的投资思路,杠杆水平较上一季度有所下降,组合的剩余期限也有所降低。债券选择方面,严格控制AAA以下资产的比例,有效防范信用风险;同业存款方面,结合银行评级情况和存款利率,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30天债券A的基金份额净值收益率为0.7878%,本报告期汇添富理财30天债券B的基金份额净值收益率为0.8599%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%。

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	13,992,637,680.26	43.93
	其中:债券	13,992,637,680.26	43.93
	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	17,632,465,171.35	55.35
4	其他资产	230,279,358.14	0.72
5	合计	31,855,382,209.75	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	6.53	
	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	1,584,865,047.63	5.24
	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	98
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	143
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	90

报告期内投资组合平均剩余期限超过150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150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	9.20	5.24
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	17.26	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	43.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	6.57	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	27.63	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		104.63	5.24

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	1,950,506,077.26	6.45
	其中:政策性金融债	1,950,506,077.26	6.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,099,410,973.39	3.64
6	中期票据	-	-
7	同业存单	10,942,720,629.61	36.20
8	其他	-	-
9	合计	13,992,637,680.26	46.29
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	111872641	18四川天府银行CD082	5,000,000	495,047,674.01	1.64
2	111873689	18湖北银行CD122	5,000,000	491,667,581.82	1.63
3	180209	18国开09	4,700,000	470,395,257.64	1.56
4	111872061	18江阴农村商业银行CD110	4,000,000	396,799,297.57	1.31
5	180407	18农发07	3,800,000	380,084,169.39	1.26
6	190201	19国开01	3,300,000	329,980,836.29	1.09
7	041800009	18电网CP003	3,000,000	299,407,492.68	0.99
8	111810402	18兴业银行CD402	3,000,000	298,527,503.44	0.99
9	111870021	18昆仑银行CD117	3,000,000	298,429,538.37	0.99
10	111906094	19交通银行CD094	3,000,000	298,154,091.11	0.99

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	0.1567%
报告期内偏离度的最低值	0.0789%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1204%

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投资。

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,按票面利率或固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	-
3	应收利息	230,279,358.14
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	230,279,358.14

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	551,197,295.14	29,722,462,557.01
报告期期间基金总申购份额	3,628,865.91	272,753,411.17
报告期期间基金总赎回份额	146,811,205.80	175,494,530.64
报告期期末基金份额总额	408,014,955.25	29,819,723,437.54

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	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1月1日至2019年3月31日	15,834,590,152.49	124,083,136.93	-	15,958,673,189.42	99.12	
个人	-	-	-	-	-	-	-	-

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赎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7天债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富理财7天债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富理财7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7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