

汇添富 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 09 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 22 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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 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 7 月 1 日起至 2019 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇添富 90 天短债
基金主代码	007456
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 12 日
报告期末基金份额总额	252,652,374.68 份
投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
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	中债综合财富(1 年以下)指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人	江苏银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	汇添富 90 天短债 A	汇添富 90 天短债 B	汇添富 90 天短债 C
下属分级基金的交易代码	007456	007457	007458
报告期末下属分级基金的份额总额	191,707,622.57 份	22,002,409.71 份	38,942,342.40 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 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日）		
	汇添富 90 天短债 A	汇添富 90 天短债 B	汇添富 90 天短债 C
1. 本期已实现收益	2,672,395.17	224,077.33	370,976.17
2. 本期利润	2,911,812.03	245,191.39	410,138.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0114	0.0109	0.0113
4. 期末基金资产净值	194,357,608.89	22,295,102.35	39,478,828.28
5. 期末基金份额净值	1.0138	1.0133	1.0138

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 90 天短债 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	1.13%	0.02%	0.78%	0.01%	0.35%	0.01%

汇添富 90 天短债 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

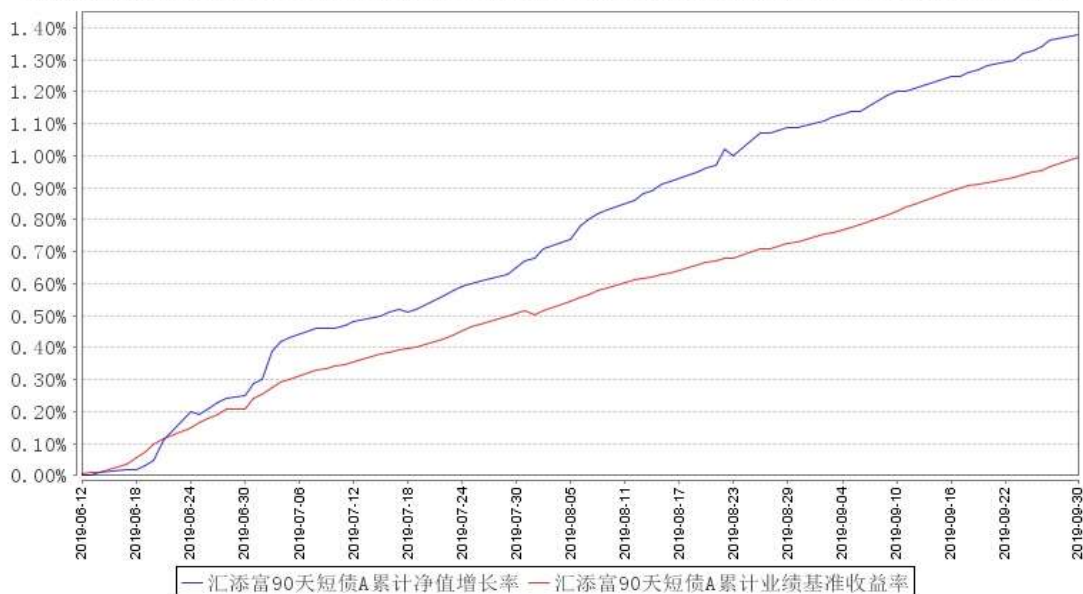
过去三个月	1.09%	0.02%	0.78%	0.01%	0.31%	0.01%
-------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

汇添富 90 天短债 C

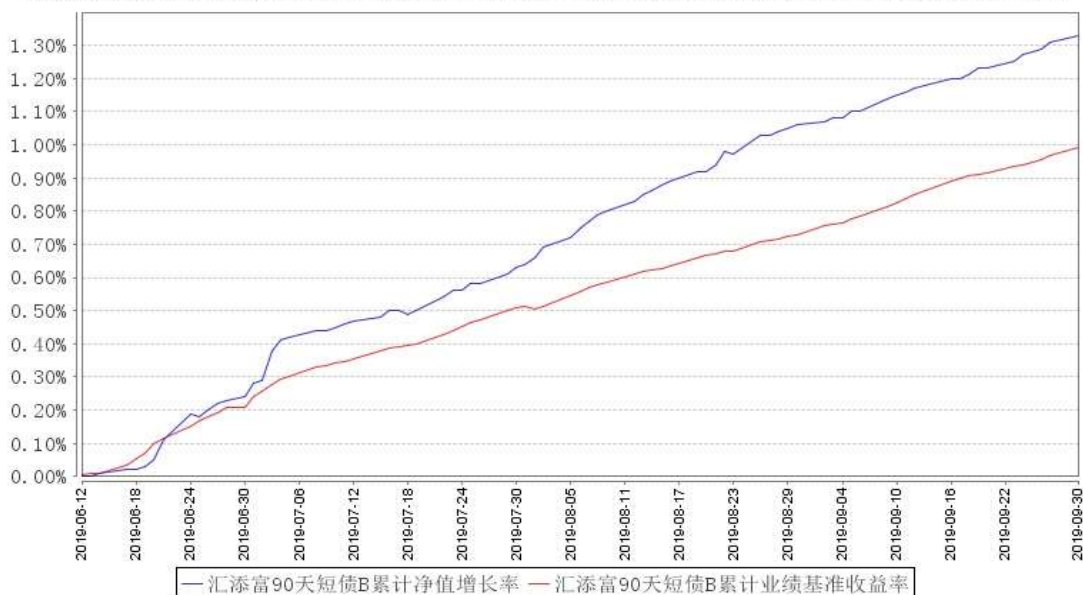
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	1.13%	0.02%	0.78%	0.01%	0.35%	0.01%

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

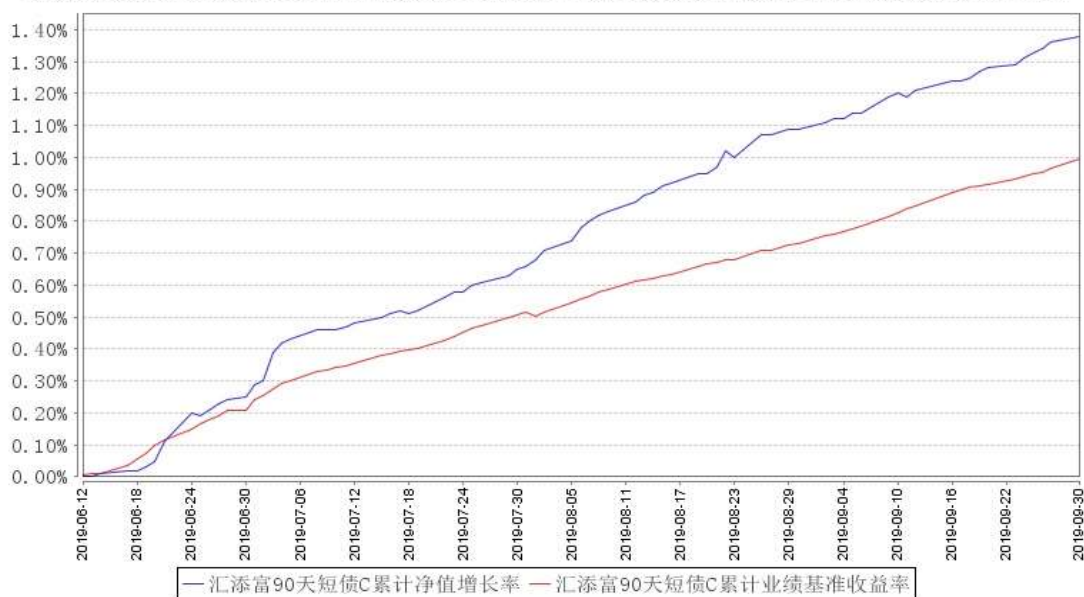
汇添富90天短债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富90天短债B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



汇添富90天短债C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日为 2019 年 6 月 12 日。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2019 年 6 月 12 日）起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

§ 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	现金宝货币基金、实业债债券基金、添富年年益定开混合、添富短债债券基金、添富丰润中短债基金、汇添富丰利短债基金、汇添富90天短债基金、汇添富稳添利定期开放债券基金、汇添富汇鑫货币基金的基金经	2019年6月12日	-	13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、债券风控研究员。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

	<p>理，汇添富多元收益债券基金的基金经理助理。</p>			<p>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的基金经理，2015 年 3 月 10 日至 2019 年 8 月 28 日任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，2015 年 3 月 10 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富理财 14 天债券基金的基金经理，2016 年 6 月 7 日至 2019 年 1 月 25 日任汇添富货币基金的基金经理，2016 年 6 月 7 日至今任实业债债券基金的基金经理，2016 年 6 月 7 日至 2019 年 1 月 25 日任添富通货币基金的基金经理，2016 年 6 月 7 日至 2018 年 5 月 4 日任理财 30 天债券基金、理财</p>
--	------------------------------	--	--	---

				<p>60 天债券基金的基金经理，2017 年 4 月 20 日至 2019 年 9 月 4 日任汇添富鑫益定开债基金的基金经理，2017 年 5 月 15 日至今任添富年年益定开混合基金的基金经理，2017 年 6 月 23 日至 2019 年 8 月 28 日任添富鑫汇定开债券基金的基金经理，2018 年 8 月 2 日至 2019 年 9 月 17 日任汇添富睿丰混合（LOF）基金、汇添富新睿精选混合基金的基金经理，2018 年 12 月 13 日至今任添富短债债券基金的基金经理，2018 年 12 月 24 日至今任添富丰润中短债基金的基金经理，2019 年 1 月 18 日至今任汇添富丰利短债基金的基金经理，2019 年 6 月 12 日至今任汇添富 90 天短债基金的基金经理，2019 年 8 月 28 日至今任汇添</p>
--	--	--	--	---

					富稳添利定期开放债券基金的基金经理，2019 年 9 月 10 日至今任汇添富汇鑫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合规守信情况的说明

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 7 次，由于组合投资策略导致。经检查和分折未发现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

今年三季度宏观经济仍然维持弱反弹格局，社融和信贷数据虽然起伏较大，但总体好于去年下半年，房地产投资和消费也体现了一定的韧性，工业增加值有所企稳，与此同时，非洲猪瘟导致的猪肉价格上涨、原油价格走高以及蔬菜水果环比涨幅较大等因素叠加推高通胀预期，债市基本面条件有所弱化。货币政策三季度仍然维持宽松稳健，央行在 9 月初进行了降准，向市场投放更多流动性。此外，为促进实体经济发展，加快落实降低实际利率，央行在三季度推进改革完善贷款市场报价利率（LPR）形成机制，LPR 报价及走势值得关注。总体而言，三季度债市呈现震荡走势。与上一个季度相比，1 年期金融债收益率持平于 2.7%附近，5 年-10 年金融债下行约 10BP。

本基金三季度规模小幅下降，考虑到组合存在一定封闭期，可以采用更稳定的杠杆策略，同时短端债券在宽松稳健的货币政策背景下回调风险可控，本基金将久期控制在 1 年左右，持仓债券以 AA+以上中高等级信用债为主，并兼顾个券的分散化，同时适当运用杠杆以增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富 90 天短债 A 基金份额净值为 1.0138 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.13%；截至本报告期末汇添富 90 天短债 B 基金份额净值为 1.0133 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.09%；截至本报告期末汇添富 90 天短债 C 基金份额净值为 1.0138 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.13%；同期业绩比较基准收益率为 0.78%。

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	346,751,500.00	98.96
	其中：债券	346,751,500.00	98.96

	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	726,679.82	0.21
8	其他资产	2,906,553.48	0.83
9	合计	350,384,733.30	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港股通股票投资。

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

注：本基金本报告期末持有股票

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	14,983,500.00	5.85
	其中：政策性金融债	14,983,500.00	5.85
4	企业债券	20,620,000.00	8.05
5	企业短期融资券	230,128,000.00	89.85
6	中期票据	81,020,000.00	31.63
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	346,751,500.00	135.38

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	101900413	19 吴江经开 MTN001	200,000	20,390,000.00	7.96
2	101551086	15 大连万达	200,000	20,234,000.00	7.90

		MTN002			
3	101755015	17 均瑶 MTN003	200,000	20,214,000.00	7.89
4	041900243	19 南浦口 CP001	200,000	20,082,000.00	7.84
5	011901294	19 京城投 SCP001	200,000	20,074,000.00	7.84

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：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	9,193.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,897,359.78

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,906,553.48

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末无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：本基金本报告期末持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富 90 天短债 A	汇添富 90 天短债 B	汇添富 90 天短债 C
报告期期初基金份额总额	259,880,217.81	20,678,001.49	33,040,586.80
报告期期间基金总申购份额	40,613,193.57	15,406,752.14	15,902,205.60
减：报告期期间基金总赎回份额	108,785,788.81	14,082,343.92	10,000,450.00
报告期期末基金份额总额	191,707,622.57	22,002,409.71	38,942,342.40

§ 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、中国证监会准予汇添富 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金注册的文件；
- 2、《汇添富 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富 90 天滚动持有短债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 90 天滚动持有短债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 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2019 年 10 月 22 日