汇添富全额宝货币市场基金 2023 年第 3 季度 报告

2023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: 中国民生银行股份有限公司

送出日期: 2023年10月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1基金基本情况

基金简称	汇添富全额宝货币
基金主代码	000397
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生 效日	2013年12月13日
报告期末基金份额总额(份)	184, 705, 731, 990. 06
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。本基金具体投资策略包括:滚动配置策略、久期控制策略、套利策略、时机选择策略。
业绩比较基 准	活期存款利率(税后)
风险收益特 征	本基金为货币市场证券投资基金,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、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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基		
金的基金简	汇添富全额宝货币 A	汇添富全额宝货币 C
称		
下属分级基		
金的交易代	000397	017062
码		
报告期末下		
属分级基金	184, 705, 223, 146. 39	508, 843. 67
的份额总额	104, 103, 223, 140. 39	500, 643. 07
(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(2023年07月01日 - 2023年09月30日)				
	汇添富全额宝货币 A	汇添富全额宝货币C			
1. 本期已实现收益	821, 888, 910. 99	1,600.92			
2. 本期利润	821, 888, 910. 99	1,600.92			
3. 期末基金资产净值	184, 705, 223, 146. 39	508, 843. 67			

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) 扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变 动收益,由于固定净值型货币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 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

单位:人民币元

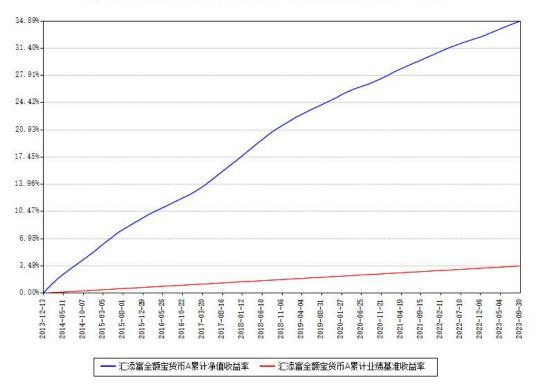
汇添富全额宝货币 A								
阶段	份额净值收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	1)-3	2-4		

过去三个 月 过去六个	0. 4548% 0. 9400%	0. 0006% 0. 0007%	0. 0894% 0. 1779%	0. 0000%	0. 3654% 0. 7621%	0. 0006%
过去一年	1.8277%	0. 0007%	0. 3549%	0.0000%	1. 4728%	0. 0007%
过去三年	6. 1230%	0.0010%	1.0646%	0.0000%	5. 0584%	0.0010%
过去五年	11. 4200%	0.0015%	1. 7753%	0.0000%	9. 6447%	0. 0015%
自基金合 同生效日 起至今	34. 8863%	0. 0034%	3. 4796%	0. 0000%	31. 4067%	0.0034%
		汇剂	紧富全额宝货	币 C		
阶段	份额净值收益率①	份额净值 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. 5156%	0. 0006%	0. 0894%	0. 0000%	0. 4262%	0. 0006%
过去六个	1. 0615%	0. 0007%	0. 1779%	0. 0000%	0.8836%	0. 0007%
自基金合同生效日	1.8458%	0. 0007%	0. 3101%	0. 0000%	1. 5357%	0. 0007%

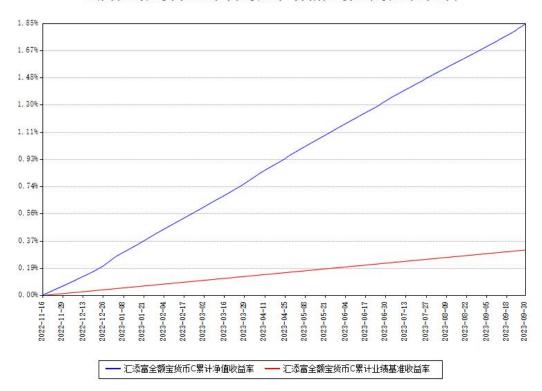
注:本基金收益分配按日结转份额。

3. 2. 2 自基金合同生效以来基金份额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





汇添富全额宝货币C累计净值收益率与同期业绩基准收益率对比图



注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年12月13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。

本基金于 2022 年 11 月 15 日新增 C 类份额,新增份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§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	基金经理期限	证券从业年	说明
XI-11	4/7	任职日期	离任日期	限(年)	DC-51
徐寅喆	本基金的基金经理,现金管理部总经理	2020年 02月 26日		15	国学大硕资投业业任保限交20加基份历易收理任部207年日利型基经年至月添线基经年籍历学士格资资经长险公易12入金有任员益助现总14日10任率证金理824富货金理11中复理从证金。:养份债。5添理公券固金,管理8201流债券的。月18日收币的。月19日学业券从从曾老有券月富股司交定经现理。月201富券资金4日5汇快场金446。

日至今任宝 资产市基金经理。2014年12月23日至2018年5月4日任汇 溶资产的基金经理。2016年6月7日至2018年5月4日至2018年5月4日产品 数金理。2016年6月7日至2018年5月4日产品 数金理。2018年5月4日产品 数金理。2018年5月4日产品 数金理。2018年5月4日产品 数金理。2018年5月4日产品 数金理。2018年5月4日至2022年3月济产品 数金理。2018年5月4日至2022年3月济产品 数金理。2018年5月4日产品 数金理。2018年5月4日产品 数金量理。2018年5月4日产品 2020年8月18章 计多段			
货的基金经理。2014年12月23日至2018年5月4日在汇 高高价格。			日至今任汇
金的基金经理。2014年 12月23日至2018年5 月4日任汇添富使收收收收价的基金全经理。2016年6月7日至2018年5 月4日任汇添富市的基金全经理。2016年6月7日至2018年5 月4日在额场金经理。2018年5 月4日添汤金经理。2018年5 月4日添汤金经理。2018年5 月4日添汤金经理。2018年5 月4日添汤金经理。2018年5 月4日添为金经理。2018年5 月4日添入投资基金。2018年5 月4日至富理财财14券投资基金。2018年5 月4日至2022年3月31日任汇流济大投资基金。2018年5月4日至2022年3月1日年汇15条1日,16年1日,16年			添富和聚宝
理。2014年 12月23日 至2018年5 月4日佐汇 添货币站场。2016年6月7日 至2018年5 月4日全 2018年5 月4日全 2018年5 月4日全 2018年5 月4上汇 添富市市基金 建。2018年5 月4上汇 添加 2018年5 月4上汇 高级 2018年5 月4日至 2022年3 月3日 日任 14年			货币市场基
12 月 23 日 至 2018 年 5 月 4 目收益市场 基金的基金 经理。2016 年 6 月 7 日 至 2018 年 5 月 4 日任紅宝 货币的基金 金的 8 2018 年 5 月 4 日至 今任汇市场金 金的。2018 年 5 月 4 日至 今性对。 企的券的基。 2018 年 5 月 4 日至 2018 年 5 月 8 日任紅 添工债券 型型金 经理 5 月 8 日 全理 5 月 8 日 全世 5 月 8 日 会世 5 月 8 日 会世 5			金的基金经
至 2018年5 月4日任汇 添高 收 市基金 收 市基金 收 市 市基金 经理。 2016年6月7日至 2018年5月4日在汇 资 场 市基金 经理。 2016年6月7日至 2018年5月4日至 6018年5月4日至 6018年5月4日至 6018年5月4日至 7018年5月4日至 7018年5月4日至 7018年5月4日至 7018年5月4日至 7018年5月4日至 7018年5月4日至 7018年5月4日至 7018年5月4日 7018年5月18日 年5月18日 年52020年8月18日 年5月18日 日 18日 日 18			理。2014年
月4日任汇 添富收益快 钱货金的。2016 年6月7日 至2018年5 月4日任额场基 金理。2018年5 月4日日富 6年6月4日百富 6年6月4日百富 6年7月4日百富 6年7月4日60 6年7月4日60 6年7月4日60 6年7月4日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日6日60 6年7月4日60 6年7月			12月23日
深高收益市场基金经理。2016年6月7日至2018年5月4日經濟场基金的基金金經理。2018年5月4日經濟场基金。市的基金金市的基金全理。2018年5月4日至今任汇添场金。2018年5月4日至今任汇添高。理财60天债券型基金的要基金经理。2018年5月4日至2022年3月31日任汇派清额数量金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任流涤率型证金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任流涤率型证金的基金经理。			至 2018 年 5
线货币市场基金的基金 经理。2016年6月7日至 2018年5月4日經定 货币市场基金 理。2018年5月4日經定 货币市基金 理。2018年5月4日至今任汇添场基金的基金 理。2018年5月4日至今任汇添天债券型证券投资基金的基金 经理。2018年5月4日至 2022年3月31日任汇添费型证券投资基金的基金 经理。2018年5月4日至 2020年8月18日任汇 添富 經濟學 型证券投资基金的基金 经理。2018年5月4日至 2020年8月18日任汇 添富 经产 5月4日至 2020年8月18日任汇 添富 经经理。			月4日任汇
基金的基金经理。2016年6月7日至2018年5月4日任汇添资市市场金经理。2018年5月4日至6份的基金经理。2018年5月4日至6份的基金经理。2018年5月4日至6分任汇添路基金的。2018年5月4日至7分任汇添拾数基金。金经期。2018年5月4日至2022年3月31日任汇添货数基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添拾整理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添拾整理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添拾整理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添拾整理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇			添富收益快
经理。2016年6月7日至2018年5月4日任汇添富市市场基金经理。2018年5月4日任汇添高市市场基金经理。2018年5月4日至今任汇添富货币市基金经理。2018年5月4日至今任汇添富理财160天债券型证券收货基金理。2018年5月4日至2022年3月31日任汇添算工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工			钱货币市场
年6月7日至2018年5月4日任汇 添富全额宝货币市场。基金经理。2018年5月4日至。2018年5月4日至今任汇添富货币市场。基金经理。2018年5月4日至今任汇添富理财160天债券型证券投资基金理。2018年5月4日至2022年3月3富理财14天投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫档券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫档券投资基金的基金经理。			基金的基金
至 2018 年 5 月 4 日任汇 添富全额宝货币市场基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至今任币场基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至今任汇添富货币市场基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至今任汇添入资基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至 2022 年 3 月 31 日任汇添请费型证券投资基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至 2020 年 8 月 18 日在汇添富整构债券型证券投资基金的基金经理。			经理。2016
月4日任汇 添富全额宝货币场基金经理。2018年 5月4日至今任汇添富货币的基金经理。2018年 5月4日至今任汇添富 理财60天债券型证券投资基金理。2018年5月4日至 2018年5月4日至2022年3月31日 任汇为者的基金经理。2018年5月4日至2022年3月31日 任汇次债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18届信任厂添富金额证券投资基金的基金经理。			年6月7日
添富全额宝货币场基金经理。2018年5月4日至今任汇添富货币市场基金处理。2018年5月4日至今任汇市场基金处理。2018年5月4日至今任财60天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2022年3月31日任汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。			至 2018 年 5
添富全额宝货币场基金经理。2018年5月4日至今任汇添富货币市场基金处理。2018年5月4日至今任汇市场基金处理。2018年5月4日至今任财60天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2022年3月31日任汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。			月4日任汇
金的基金经理。2018年5月4日至今任汇添富货币市场基金的基金经理。2018年5月4日至今任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2022年3月31日任汇添富费型财14天投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。			
金的基金经理。2018年5月4日至今任汇添富货币市场基金的基金经理。2018年5月4日至今任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2022年3月31日任汇添富费型财14天投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。			货币市场基
理。2018年5月4日至今任汇添富货币市场基金的基金经理。2018年5月4日至今任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2022年3月31日任汇添富遭理财14天债券型证券投资基金。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。			
今任汇添富货币市场基金的基金经理。2018年5月4日至今任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2022年3月31日任汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。			
货币市场基金的基金经理。2018年5月4日至今任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2022年3月31日任汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫补债券型证券投资基金的基金经理。			5月4日至
货币市场基金的基金经理。2018年5月4日至今任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2022年3月31日任汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫补债券型证券投资基金的基金经理。			今任汇添富
理。2018年5月4日至今任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2022年3月31日任汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。			
5月4日至 今任汇添富 理财60天债 券型证券投 资基金的基 金经理。 2018年5月 4日至 2022年3月31日 任汇添富理 财14天债券 型证券投资 基金的基金 经理。2018年5月4日 至2020年8月18日任汇 添富鑫禧债 券型证券投 资基金的基 金经理。			金的基金经
今任汇添富 理财 60 天债 券型证券投 资基金的基 金经理。 2018 年 5 月 4 日至 2022 年 3 月 31 日 任汇添富理 财 14 天债券 型证券投资 基金的基金 经理。2018 年 5 月 4 日 至 2020 年 8 月 18 日任汇 添富鑫 债 券型证券投 资基金的基 金经理。			理。2018年
理财 60 天债			5月4日至
券型证券投资基金的基金经理。 2018年5月4日至2022年3月31日任汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。			今任汇添富
资基金的基金经理。 2018年5月4日至2022年3月31日任汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。			理财 60 天债
金经理。 2018年5月 4日至2022年3月31日 任汇添富理 财14天债券 型证券投资 基金的基金 经理。2018年5月4日 至2020年8月18日任汇 添富鑫禧债 券型证券投资 基金的基 金经理。			券型证券投
2018年5月 4日至2022年3月31日 任汇添富理 财14天债券 型证券投资基金的基金 经理。2018年5月4日 至2020年8月18日任汇 添富鑫禧债 券型证券投资基金的基 金经理。			资基金的基
4 日至 2022 年 3 月 31 日 任汇添富理 财 14 天债券 型证券投资 基金的基金 经理。2018 年 5 月 4 日 至 2020 年 8 月 18 日任汇 添富鑫禧债 券型证券投 资基金的基 金经理。			金经理。
年 3 月 31 日 任汇添富理 财 14 天债券 型证券投资 基金的基金 经理。2018 年 5 月 4 日 至 2020 年 8 月 18 日任汇 添富鑫禧债 券型证券投 资基金的基 金经理。			2018年5月
任汇添富理 财 14 天债券 型证券投资 基金的基金 经理。2018 年 5 月 4 日 至 2020 年 8 月 18 日任汇 添富鑫禧债 券型证券投 资基金的基 金经理。			4 日至 2022
财 14 天债券型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。			年 3 月 31 日
型证券投资基金的基金经理。2018年5月4日至2020年8月18日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。			任汇添富理
基金的基金 经理。2018 年 5 月 4 日 至 2020 年 8 月 18 日任汇 添富鑫禧债 券型证券投 资基金的基 金经理。			财 14 天债券
经理。2018 年 5 月 4 日 至 2020 年 8 月 18 日任汇 添富鑫禧债 券型证券投 资基金的基 金经理。			型证券投资
年 5 月 4 日 至 2020 年 8 月 18 日任汇 添富鑫禧债 券型证券投 资基金的基 金经理。			
至 2020 年 8 月 18 日任汇 添富鑫禧债 券型证券投 资基金的基 金经理。			经理。2018
月 18 日任汇 添富鑫禧债 券型证券投 资基金的基 金经理。			
添富鑫禧债 券型证券投 资基金的基 金经理。			
券型证券投资基金的基金经理。			
资基金的基 金经理。			添富鑫禧债
金经理。			券型证券投
			资基金的基
2019年1月			
			2019年1月

		25 日至今任
		汇添富添富
		通货币市场
		基金的基金
		经理。2019
		年9月10日
		至 2022 年
		10月14日
		任汇添富汇
		鑫浮动净值
		型货币市场
		基金的基金
		经理。2020
		年 2 月 26 日
		至今任汇添
		富全额宝货
		币市场基金
		的基金经理。
		2020年2月
		26 日至今任
		汇添富收益
		快线货币市
		场基金的基
		金经理。
		2021年6月
		24 日至今任
		汇添富稳利
		60 天滚动持
		有短债债券
		型证券投资
		基金的基金
		经理。2022
		年1月25日
		至今任汇添
		富稳福 60 天
		滚动持有中
		短债债券型
		证券投资基
		金的基金经
		理。2022年
		5月9日至
		今任汇添富
		现金宝货币
		市场基金的
		基金经理。
		2023年9月

	1				
					13 日至今任
					汇添富稳瑞
					30 天滚动持
					有中短债债
					券型证券投
					资基金的基
					金经理。
					2023年9月
					14 日至今任
					汇添富稳益
					60 天持有期
					债券型证券
					投资基金的
					基金经理。
					国籍:中国。
					学历:复旦
					大学管理学
					硕士。从业
					资格:证券
					投资基金从
					业资格。从
					业经历:
					2014年9月
					至 2016 年 4
					月任上海国
					际货币经纪
					有限责任公
					司债券经纪
					人。2016年
	本基金的基	2023年03		_	5月至2018
王骏杰	金经理	月 15 日	_	9	年6月任汇
		, ,			添富基金管
					理股份有限
					公司债券交
					易员,2018
					年7月至
					2019年8月
					²⁰¹⁹
					金管理股份
					金官珪成份
					级债券交易
					员。2019年
					9月1日至
					2020年8月
					26 日任汇添
					富和聚宝货

		币市场基金
		的基金经理
		助理。2019
		年 10 月 30
		日至 2020
		年8月26日
		任汇添富汇
		鑫浮动净值
		型货币市场
		基金的基金
		经理助理。
		2020年2月
		28 日至 2023
		年 3 月 15 日
		任汇添富全
		额宝货币市
		场基金的基
		金经理助理。
		2020年2月
		28 日至今任
		汇添富收益
		快钱货币市
		场基金的基
		金经理助理。
		2020年2月
		28 日至 2022
		年 5 月 13 日
		任汇添富收
		益快线货币
		市场基金的
		基金经理助
		理。2020年
		8月26日至
		今任汇添富
		和聚宝货币
		市场基金的
		基金经理。
		2020年8月
		26 日至今任
		汇添富汇鑫
		浮动净值型
		货币市场基
		金的基金经
		理。2021年
		7月1日至
		2022年5月

		13 日任汇添
		富稳利 60 天
		滚动持有短
		债债券型证
		券投资基金
		的基金经理
		助理。2022
		年 2 月 23 日
		至 2023 年 9
		月 11 日任汇
		添富稳福 60
		天滚动持有
		中短债债券
		型证券投资
		基金的基金 经理助理。
		2022年5月
		13 日至今任
		汇添富收益
		快线货币市
		场基金的基
		金经理。
		2022年5月
		13 日至今任
		汇添富稳利
		60 天滚动持
		有短债债券
		型证券投资
		基金的基金
		经理。2023
		年 3 月 15 日
		至今任汇添
		富全额宝货
		币市场基金
		的基金经理。
		2023年6月
		20 日至今任
		汇添富稳航
		30 天持有期
		债券型证券
		投资基金的
		基金经理。
		2023年9月
		11 日至今任
		汇添富稳福
		60 天滚动持

		有中短债债
		券型证券投
		资基金的基
		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"离任日期"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相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《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。本基金无重大违法、 违规行为,本基金投资运作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

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

- 一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。
- 二、本着"时间优先、价格优先"的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统中的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。
- 三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上,本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,严格执行 了公平交易制度,公平对待了旗下各投资组合。本报告期内,未出现违反公平交易制度的 情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内,本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的 5%的情况有 14 次,投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控,事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析,未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023年三季度,海外方面,美联储7月议息会议加息25BP,9月议息会议暂停加息,但释放出维持高利率在更长时间的鹰派信号;欧央行与英国央行7月加息25BP,欧央行9月超预期加息25BP,并暗示本轮加息周期的结束,后续将进入高利率维持期;英央行在通胀意外降温驱动下,9月暂停加息,为本轮加息周期以来首次。总体上美国经济韧性仍在,劳动力市场依然强劲;欧、英、日经济前景面临不确定性,衰退预期增强。欧美经济分化,全球经济面临的下行风险加大,外部环境不确定性仍较高。

国内方面,经济呈现弱修复特征,9月制造业、建筑业和服务业PMI 同步回升至荣枯线以上。消费方面,商品消费增长提速,服务消费保持较快增长。投资方面,虽然8月份固定资产投资增速仍延续下行,但结构上制造业与高新技术领域表现较好。地产投资持续承压,地产销售持续低迷下,政策加速落地,831房地产新政基本确定房地产调控进入新阶段。出口方面,8月份出口同比降幅收窄,外需有所企稳。总体看,制造业投资、出口等变量均在逐渐好转,经济修复的方向确定但向上弹性有限,经济内生动能恢复的微观基础仍需增量政策呵护。政策层面,7月政治局会议积极回应市场关切的房地产、资本市场建设以及地方政府债务三个核心领域问题,后续配套政策陆续落地,但政策效果验证仍需要时间。货币政策,央行仍以流动性呵护为主,8月15日降息、9月15日降准充分体现呵护态度,预计后续货币政策仍然有空间。市场表现方面,临近季末月资金面对短端收益率影响较大,1年期同业存单从7月初2.3%附近上行至9月末2.5%附近。

操作上,报告期内本基金以银行存款、同业存单为主要配置资产,采取相对灵活的投资策略,在关键时点适度拉长投资组合剩余期限,控制组合风险的同时尽力为持有人获取稳定回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富全额宝货币 A 类份额净值收益率为 0. 4548%,同期业绩比较基准收益率为 0. 0894%。本报告期汇添富全额宝货币 C 类份额净值收益率为 0. 5156%,同期业绩比较基准收益率为 0. 0894%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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	73, 659, 891, 299. 84	36. 96
	其中:债券	73, 659, 891, 299. 84	36. 96
	资产支持证券	_	-
2	买入返售金融资产	47, 720, 578, 055. 99	23. 94
	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	77, 918, 188, 892. 19	39. 10
4	其他资产	_	_
5	合计	199, 298, 658, 248. 02	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)		
1	报告期内债券回购融资余额	6. 44		
	其中: 买断式回购融资	-		
序号	项目	金额 (元)	占基金资产净值的比例(%)	
	报告期末债券回购融资余额	14, 455, 386,	7. 83	
2		181. 08		
	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: 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	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	80

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

 	平均剩余期限	各期限资产占基金资产	各期限负债占基金资产
序号		净值的比例(%)	净值的比例(%)
1	30 天以内	34. 31	7. 85
	其中:剩余存续期超过397天	_	-
	的浮动利率债		
2	30天(含)—60天	12. 18	-
	其中:剩余存续期超过397天	_	_
	的浮动利率债		
3	60天(含)—90天	27. 18	-
	其中:剩余存续期超过397天	_	-
	的浮动利率债		
4	90天(含)—120天	5. 54	_
	其中:剩余存续期超过397天	-	-
	的浮动利率债		
5	120天(含)—397天(含)	28. 37	_

	其中: 剩余存续期超过 397 天	-	-
	的浮动利率债		
合计		107. 58	7. 85

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, 517, 022, 932. 82	1. 36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8, 030, 828, 788. 49	4. 35
	其中: 政策性金融债	7, 694, 916, 876. 10	4. 17
4	企业债券	400, 287, 210. 96	0. 22
5	企业短期融资券	8, 280, 463, 112. 74	4. 48
6	中期票据	-	_
7	同业存单	54, 431, 289, 254. 8	29. 47
		3	
8	地方政府债	_	-
9	其他	-	-
10	合计	73, 659, 891, 299. 8	39. 88
		4	
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	占基金资产 净值比例 (%)
1	112381031	23 宁波银行	13, 500, 000	1, 344, 148, 7	0. 73
	112301031	CD122	15, 500, 000	77. 13	0.73

2	230401	23 农发 01	12, 600, 000	1, 278, 168, 1 23. 72	0. 69
3	239941	23 贴现国债	12, 300, 000	1, 223, 553, 9	0.66
		41	, ,	68. 16	
4	112302028	23 工商银行	12,000,000	1, 185, 628, 5	0. 64
	112502020	CD028	12, 000, 000	79. 21	0.01
5	119917915	23 光大银行	11,000,000	1, 094, 265, 6	0. 59
0	112317215	CD215	11,000,000	27. 74	0.59
	112304029	23 中国银行	10,000,000	998, 534, 493	0. 54
6		CD029	10, 000, 000	. 50	0.04
_	112313035	23 浙商银行	10,000,000	997, 377, 699	0. 54
7	112313033	CD035	10, 000, 000	. 74	0.04
8	119202106	23 农业银行	10,000,000	997, 225, 778	0. 54
0	112303186	CD186	10, 000, 000	. 35	0.04
	119292010	23 邮储银行	10,000,000	996, 034, 540	0. 54
9	112322018	CD018	10,000,000	. 43	0.54
10	112386703	23 广州银行	10,000,000	995, 376, 125	0.54
		CD081	10,000,000	. 59	0. 54

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. 0633%
报告期内偏离度的最低值	-0. 0126%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0. 0432%

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 0.50%情况说明

注:本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.50%的情况。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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 基金计价方法说明

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中,宁波银行股份有限公司、中国农业发展银行、中国工商银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、广州银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.9.3 其他资产构成

注: 本基金本报告期末无其他资产。

§6开放式基金份额变动

单位: 份

项目	汇添富全额宝货币 A	汇添富全额宝货币C	
本报告期期初基金份额总额	180, 121, 141, 697. 10	262, 300. 26	
本报告期基金总申购份额	723, 407, 716, 183. 72	354, 834. 48	
减:本报告期基金总赎回份额	718, 823, 634, 734. 43	108, 291. 07	
本报告期期末基金份额总额	184, 705, 223, 146. 39	508, 843. 67	

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交易明细

注: 本基金的基金管理人本报告期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者超过 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全额宝货币市场基金募集的文件;
- 2、《汇添富全额宝货币市场基金基金合同》;
- 3、《汇添富全额宝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、报告期内汇添富全额宝货币市场基金在规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

上海市黄浦区外马路 728 号

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 2023 年 10 月 25 日