汇添富理财14天债券型证券投资基金

【2012】第四季度报告

基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富理财14天债券	
交易代码	470014	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年7月10日	
报告期末基金份额总额	425,327,563.95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	本基金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134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	本基金属于短期理财债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金及普通债券型证券投资基金。	
基金管理人	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	汇添富理财14天债券A	汇添富理财14天债券B
下属两级基金的交易代码	470014	471014
报告期末下属两级基金的份额总额	376,668,869.58份	48,658,694.37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(2012年10月1日-2012年12月31日)	
	汇添富理财14天债券A	汇添富理财14天债券B
1. 本期已实现收益	4,197,086.70	1,295,360.95
2.本期利润	4,197,086.70	1,295,360.95
3.期末基金资产净值	376,668,869.58	48,658,694.37

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14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	0.6952%	0.0016%	0.3393%	0.0000%	0.3559%	0.0016%

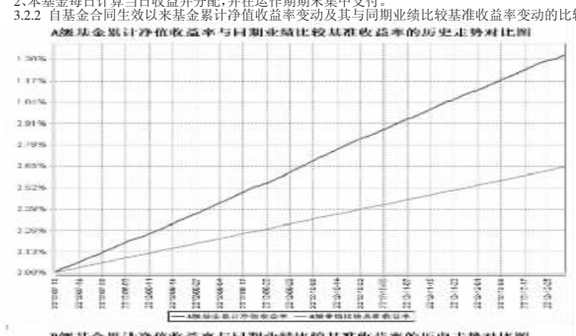
注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。
2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

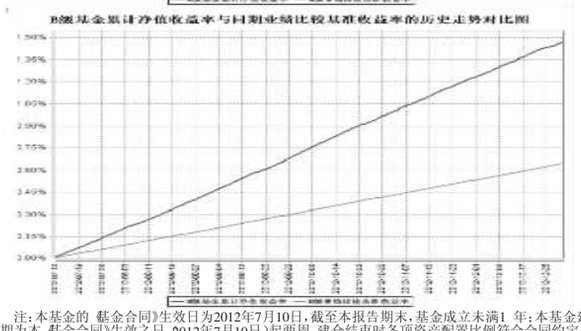
汇添富理财14天债券B

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	0.7695%	0.0016%	0.3393%	0.0000%	0.4302%	0.0016%

注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。
2、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收益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2012年7月10日,截至本报告期末,基金成立未满1年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2012年7月10日)起两周,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		
王炯	本基金的基金经理,汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理,汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理。	2012年7月10日	-	10年	国籍:中国。学历:同济大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任上海永嘉投资管理有限公司研究员。2004年11月加入汇添富基金管理有限公司任高级行业研究员,2009年11月30日至2010年2月4日任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理助理,2010年2月5日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理,2010年9月21日至今任汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理,2012年7月10日至今任汇添富理财14天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,形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合,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

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》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内,本公司管理的所有投资组合未发生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%的情形。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年四季度食品价格略有上涨,PPI仍为负值,通胀形势总体温和;PMI继续走稳,工业增加值同比增幅扩大,圣诞前后出口数据乐观,印证了经济见底回升的判断;同期央行持续逆回购,令市场资金面保持相对的宽松,12月底的资金面也迅速恢复;四季度是各类机构配置需求相对清淡的时期,且本期股票市场出现热点,债券市场收益率小幅震荡,以短融为代表的短端收益率上扬20-30BP,至年底在交易盘带动下快速下行。今年银行理财和资金池对中长期债券的需求旺盛,四季度长端收益率大体平稳,交易也较为活跃。

本基金成立于7月初,初始规模较大,受三季度以来短融收益率持续走高和规模剧烈变动的影响,组合产生小幅的负偏离,收益率相对同期处于较低水平。四季度做了积极的努力,减持了部分低效的券种,调整了结构,存款期限也适当缩减,至年底已逐步取得主动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金A级本期净值收益率为0.6952%,B级本期净值收益率为0.7695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

推动2013年经济增长的政策新亮点是新型城镇化,好的导向需要多方面的政策放松来落实,户籍、教育、就业等多方面都是需要魄力去突破的难点,此外资金不足也会限制经济回升的进度,整体上我们认为中国经济确已见底企稳,但潜在增长率已经下台阶,GDP增速保持在8%附近就是成绩,对经济的有限乐观判断下,债市的整体风险不大,但货币政策可能只有2-3次降准的预期,目前的债市已处于中性区间,机会同样有限。2013年信用风险事件可能接近暴露的边缘,信用利差扩大的趋势明确,有必要重视并早作安排。

本基金将充分利用春节前资金紧张带来的机会,提前做好债券与存款之间的配置计划。本基金的组合流动性管理特征不同于普通货币基金,在总结前期经验教训的基础上,我们将更加明确地注重流动性,做好份额变动的分析和预测,合理搭配协存、短融、浮息债等品种,力争提高组合收益。

§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	155,111,781.68	33.56
	其中:债券	140,111,781.68	30.32
	资产支持证券	15,000,000.00	3.25
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	227,734,627.71	49.27
4	其他资产	79,338,203.54	17.17
5	合计	462,184,612.93	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	6.58	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	34,489,748.26	8.11
	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	82
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	128
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	67

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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134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	58.48	8.11
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	7.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	24.70	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	90.25	8.11

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,977,813.92	4.70
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	120,133,967.76	28.25
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	140,111,781.68	32.94
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 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	041260039	12渝机电CP001	300,000	30,034,170.39	7.06
2	041264016	12科伦CP001	200,000	20,027,625.29	4.71
3	041253038	12苏核电CP001	200,000	20,007,298.93	4.70
4	041273003	12开元投CP001	200,000	20,000,397.33	4.70
5	129904	12贴现国债04	200,000	19,977,813.92	4.70
6	041259024	12苏豪CP001	100,000	10,049,222.57	2.36
7	041254031	12天生桥CP001	100,000	10,012,248.85	2.35
8	041253036	12中水电CP003	100,000	10,003,004.40	2.35

5.6 "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	-0.01%
报告期内偏离度的最低值	-0.09%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.06%

5.7 报告期末按公允价值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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119023	华侨城1	150,000.00	15,000,000.00	3.53

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.8.4 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	1,000,650.00
3	应收利息	2,280,053.54
4	应收申购款	76,057,500.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	79,338,203.54

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富理财14天债券A	汇添富理财14天债券B
本报告期期初基金份额总额	1,276,459,812.54	268,792,226.84
本报告期基金总申购份额	867,987,786.76	623,828,751.71
减:本报告期基金总赎回份额	1,767,778,729.72	843,962,284.18
本报告期期末基金份额总额	376,668,869.58	48,658,694.37

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富理财14天债券型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富理财14天债券型证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富理财14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14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。

7.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理有限公司

7.3 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。

汇添富基金管理有限公司
2013年1月21日

汇添富理财30天债券型证券投资基金

【2012】第四季度报告

基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21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2013年1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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富理财30天债券	
交易代码	470030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年5月9日	
报告期末基金份额总额	6,710,800,859.33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150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	本基金管理人将经营管理中的主要风险划分为投资风险、合规风险、营运风险和道德风险四大类,其中,投资风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险等。针对上述各类风险,基金管理人建立了一套完整的风险管理体系	
基金管理人	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	汇添富理财30天债券A	汇添富理财30天债券B
下属两级基金的交易代码	470030	471030
报告期末下属两级基金的份额总额	4,556,888,049.63份	2,153,912,809.70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(2012年10月1日-2012年12月31日)	
	汇添富理财30天债券A	汇添富理财30天债券B
1. 本期已实现收益	57,233,952.45	21,774,915.67
2.本期利润	57,233,952.45	21,774,915.67
3.期末基金资产净值	4,556,888,049.63	2,153,912,809.70

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30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	0.8701%	0.0016%	0.3393%	0.0000%	0.5308%	0.0016%

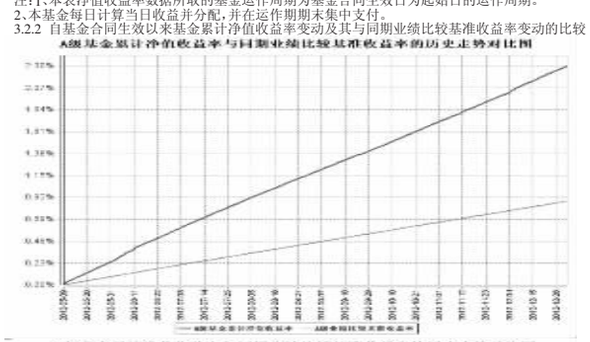
注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。
2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

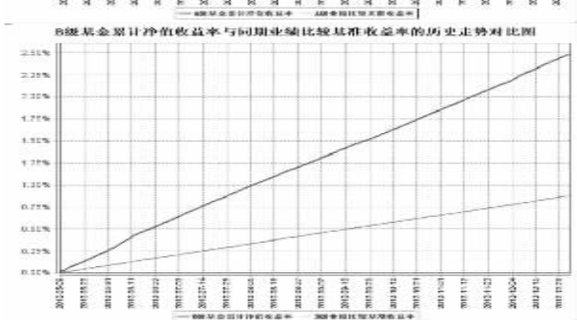
汇添富理财30天债券B

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	0.9441%	0.0016%	0.3393%	0.0000%	0.6048%	0.0016%

注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。
2、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收益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2012年5月9日,截至本报告期末,基金成立未满1年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2012年5月9日)起6个月,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		
曾刚	本基金的基金经理,汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理,汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理,汇添富理财28天债券型证券投资基金。	2012年5月9日	-	11年	国籍:中国,1971年出生,中国科技大学学士,清华大学MBA。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾在红塔证券自营业务总部、汉唐证券债券业务总部、华宝兴业基金管理有限公司研究部负责宏观经济和债券的研究,上海电气集团财务有限责任公司资产管理部任经理助理,2008年5月15日至2010年2月5日任华富基金管理有限公司华富货币基金的基金经理,2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强债券基金的基金经理,2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报债券基金的基金经理。2011年11月加入汇添富基金管理有限公司,任金融工程部高级经理。2012年5月9日至今任汇添富理财30天债券型证券投资基金的基金经理,2012年6月12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,2012年9月18日至今任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理,2012年10月18日至今任汇添富理财28天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,形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合,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

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》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内,本公司管理的所有投资组合未发生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%的情形。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年四季度食品价格略有上涨,PPI仍为负值,通胀形势总体温和;PMI继续走稳,工业增加值同比增幅扩大,圣诞前后出口数据乐观,印证了经济见底回升的判断;同期央行持续逆回购,令市场资金面保持相对的宽松,12月底的资金面也迅速恢复;四季度是各类机构配置需求相对清淡的时期,且本期股票市场出现热点,债券市场收益率小幅震荡,以短融为代表的短端收益率上扬20-30BP,至年底在交易盘带动下快速下行。今年银行理财和资金池对中长期债券的需求旺盛,四季度长端收益率大体平稳,交易也较为活跃。

本基金四季度整体较为平稳,积极调整信用债结构,稳妥地应对规模的变化。资金面整体较为宽松,银行对于同业存款的需求下降,存款利率相对于短期融资券的价值下降,本基金相应地减少了存款的配置,至年终重新提高了存款比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

四季度本基金A级净值收益率为0.8701%,B级净值收益率为0.9441%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

推动2013年经济增长的政策新亮点是新型城镇化,好的导向需要多方面的政策放松来落实,户籍、教育、就业等多方面都是需要魄力去突破的难点,此外资金不足也会限制经济回升的进度,整体上我们认为中国经济确已见底企稳,但潜在增长率已经下台阶,GDP增速保持在8%附近就是成绩,对经济的有限乐观判断下,债市的整体风险不大,但货币政策可能只有2-3次降准的预期,目前的债市已处于中性区间,机会同样有限。2013年信用风险事件可能接近暴露的边缘,信用利差扩大的趋势明确,有必要重视并早作安排。

春节前资金一般较为紧张,同业存款的利率会提升,我们将综合分析本基金的份额变动,提前做好债券与存款之间的配置计划。本基金的组合流动性管理特征不同于普通货币基金,在总结前期经验教训的基础上,我们将更加明确地注重流动性,做好份额变动的分析和预测,合理搭配协存、短融、浮息债等品种,力争提高组合收益。

§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	3,232,318,777.65	48.06
	其中:债券	3,232,318,777.65	48.06
	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	3,388,469,811.39	50.38
4	其他资产	105,144,246.84	1.56
5	合计	6,725,932,835.88	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.35	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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	104
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	74

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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	13.94	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.04	-
2	30天(含)-60天	10.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	31.39	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	8.73	-
4	90天(含)-180天	27.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	15.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.66	-

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	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	1,096,482,883.67	16.34
	其中:政策性金融债	1,096,482,883.67	16.34
4	企业债券	107,707,358.45	1.60
5	企业短期融资券	1,928,046,104.11	28.73
6	中期票据	100,082,431.42	1.49
7	其他	-	-
8	合计	3,232,318,777.65	48.17
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	656,000,916.79	9.78

5.5 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	120227	12国开27	5,800,000	576,157,634.65	8.59
2	041251015	12铁道CP001	4,050,000	405,514,709.84	6.04
3	120228	12国开28	2,900,000	289,795,335.00	4.32
4	041258039	12上海港CP002	1,400,000	139,952,537.30	2.09
5	041254038	12电网CP001	1,100,000	110,006,967.68	1.64
6	041259058	12国电集CP003	1,000,000	100,056,708.62	1.49
7	080210	08国开10	800,000	80,658,034.82	1.20
8	041259027	12晋能源CP001	800,000	80,407,802.03	1.20
9	041251019	12浙物产CP001	700,000	70,012,429.67	1.04
10	120233	12国开33	700,000	69,846,986.44	1.04

5.6 "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	-0.07%
报告期内偏离度的最低值	-0.16%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.11%

5.7 报告期末按公允价值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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	125,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	72,365,532.60
4	应收申购款	32,653,714.24
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	105,144,246.84

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富理财30天债券A	汇添富理财30天债券B
本报告期期初基金份额总额	9,468,416,314.61	2,396,276,765.33
本报告期基金总申购份额	1,879,574,551.26	1,198,666,481.00
减:本报告期基金总赎回份额	6,791,102,816.24	1,441,030,436.63
本报告期期末基金份额总额	4,556,888,049.63	2,153,912,809.70

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富理财30天债券型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富理财30天债券型证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富理财30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30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。

7.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理有限公司

7.3 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。

汇添富基金管理有限公司
2013年1月21日

汇添富理财60天债券型证券投资基金

【2012】第四季度报告

基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21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2013年1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、