汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)

【2015】第三季度报告

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:2015年10月27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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富黄金及贵金属(QDII-LOF-FOF)
场内简称	添富贵金
交易代码	164701
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月31日
报告期末基金份额总额	327,310,511.90份
投资目标	深入研究影响黄金及其他贵金属(如白银、铂金、钯金等)价格的主要因素,把握不同品种贵金属的长期价格趋势和短期市场波动,通过主动投资于有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF),在严格控制风险的前提下,力争基金收益率超越同期黄金价格走势。
投资策略	综合考虑国际政治、经济、汇市、战争、主要国家货币和利率政策、贵金属市场供求等多方面因素,本基金重点投资于境外上市有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF),长期持有结合动态调整。 本基金主要投资策略包括贵金属资产配置策略、交易所交易基金(ETF)投资策略、货币市场工具投资策略以及金融衍生工具投资策略。
业绩比较基准	伦敦金价格折成人民币后的收益率 (伦敦金每日价格采用伦敦金下午定盘价(London Gold Price PM Fix),人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。)
风险收益特征	本基金为基金中基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,主要投资于境外有实物黄金或其他实物贵金属支持的交易所交易基金(ETF),其预期风险收益水平与黄金价格相似。
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

注:本基金为LOF基金,在深交所的简称为"添富贵金"。

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		NY 10005

§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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-38,838,239.00
2.本期利润	-24,057,946.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0692
4.期末基金资产净值	174,763,384.06
5.期末基金份额净值	0.534

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。

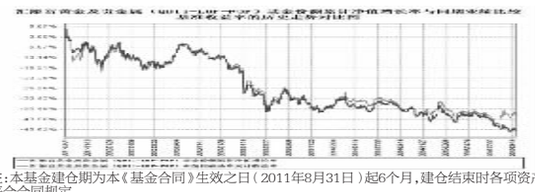
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-11.59%	0.99%	-11.01%	1.09%	-10.58%	-0.10%

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(2011年8月31日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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		
赖中立	汇添富黄金及贵金属基金(LOF)的基金经理、汇添富恒生指数分级(QDII)基金、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF联接基金、汇添富香港优势精选混合基金的基金经理。	2012年11月1日	-	8年	国籍:中国,学历:北京大学中国经济研究中心金融学硕士,相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任金融工程部分析师、基金经理助理。2012年11月1日至今任汇添富黄金及贵金属基金(LOF)的基金经理,2014年3月6日至今任汇添富恒生指数分级(QDII)基金的基金经理,2015年1月6日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理,2015年5月26日至今任汇添富香港优势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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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1次,是由于合规控制原因调整导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,全球黄金市场维持小幅震荡的格局,纽约Comex金价从2015年6月底的1172美元经历小幅震荡后,至2015年9月底小幅下跌至1115美元。

2015年三季度,美国经济出现了较为明显的分化,虽然实体经济表现较好,但金融市场却较为恐慌;同时,受中国股市大幅下挫的影响,市场对中国经济表示了极大的担忧,全球股票等风险资产受到挤压,资金流入美元等避险资产,但由于全球通胀预期表现仍然低迷,传统的避险类资产如黄金等贵金属仍受到强势美元的影响表现不佳。而8月中旬中国央行改变了人民币中间价的计算方法,人民币一次性贬值近3%,外汇市场的巨幅波动随后也传递至全球大宗商品市场,进一步加剧了贵金属市场的波动。

整个三季度,美元强势的态势仍将维持,而全球实体经济总体低迷态势超出我们的预期,整个三季度相对黄金,我们配置的受实体经济影响较大的铂金与白银表现糟糕,拖累了基金的净值表现。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金三季度上涨-11.59%,同期基准上涨-1.01%,超额收益为-10.58%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年四季度,受最新一期美国非农数据大幅低于预期的影响,美国加息将延迟,意味着全球流动性将维持相对宽松的态势,将有助于黄金价格的上涨。而从最近的经济数据来看,中国经济复苏态势仍然较弱,将对大宗商品的需求形成一定程度的压制。而欧元区经济仍没有太大起色,但同时叙利亚等地局势仍动荡不安,有望提振黄金的避险需求。

总的来看,在长期范围内我们对黄金价格仍抱有较乐观态度,但在中短期情况下,较疲软的全球经济走势,全球可能陷入通缩的担忧将持续压制市场投资者的神经,短期仍将压制黄金为首的贵金属走势。我们将持续关注美国加息进程与全球地缘政治的冲突与发展,维持合同范围内较低的黄金仓位,同时视全球经济复苏情况与通胀情况配置部分白银与铂金。

4.7 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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	0.00
	其中:普通股	-	0.00
	优先股	-	0.00
	存托凭证	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	160,910,733.81	89.66
3	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中:远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	18,413,293.43	10.26
8	其他资产	146,090.97	0.08
9	合计	179,470,118.21	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

注:本基金本报告期末未持有股票以及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 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及存托凭证投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票以及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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 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金融衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	ETFS GOLD TRUST	ETF基金	契约型开放式	ETFs Securities US (LLC)	30,517,191.72	17.46
2	UBS ETF CH-GLD CHF H	ETF基金	契约型开放式	UBS Fund Management (Switzerland) AG	30,253,194.13	17.31
3	JB PHYSICAL GOLD FND	ETF基金	契约型开放式	Swiss & Global Asset Management	27,480,816.00	15.72
4	SPROTT PHYSICAL GOLD	ETF基金	契约型开放式	Sprott Asset Management LP	26,249,904.45	15.02
5	SPDR GOLD SHARES	ETF基金	契约型开放式	State Street Bank and Trust Company	25,151,435.17	14.39
6	ISHARES GOLD TRUST	ETF基金	契约型开放式	Black Rock Fund Advisors	21,258,192.34	12.16

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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、处罚的情况。

5.10.2

本基金投资的前十名基金没有超出基金合同规定的备选基金库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	747.03
5	应收申购款	145,343.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	146,090.97

5.10.4 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可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	405,951,898.96
报告期期间基金总申购份额	43,594,521.33
减:报告期期间基金总赎回份额	122,235,908.39
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	327,310,511.90

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

7.1 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)募集的文件;

2、《汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)基金合同》;

3、《汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、报告期内汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)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。

8.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理股份有限公司

8.3 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
2015年10月27日

汇添富货币市场基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富货币
交易代码	519518
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年3月23日
报告期末基金份额总额	17,338,602,326.96份
投资目标	力求在本金稳妥和基金资产高流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。
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	税后活期存款利率(即活期存款利率×(1-利息税率))。
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	下属分级基金的交易代码 / 报告期末下属分级基金的份额总额
汇添富货币A	519518 / 323,600,448.48份
汇添富货币B	519517 / 10,132,120,447.61份
汇添富货币C	000642 / 6,574,326,209.84份
汇添富货币D	000650 / 308,555,221.03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		1.本期已实现收益	2. 本期利润	3. 期末基金资产净值
报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)	汇添富货币A	1,939,144.16	1,939,144.16	323,500,448.48
	汇添富货币B	83,853,241.86	83,853,241.86	10,132,120,447.61
	汇添富货币C	48,705,542.59	48,705,542.59	6,574,326,209.84
	汇添富货币D	2,014,992.16	2,014,992.16	308,555,221.03

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.本基金自2014年6月6日起增加C类和D类分级基金,该类分级基金只收取销售服务费,不收取申购费和赎回费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期末各分级货币基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富货币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	0.5994%	0.0006%	0.0882%	0.0000%	0.5112%	0.0006%

注:本基金收益分配按日结转份额。

汇添富货币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	0.6606%	0.0006%	0.0882%	0.0000%	0.5724%	0.0006%

注:本基金收益分配按日结转份额。

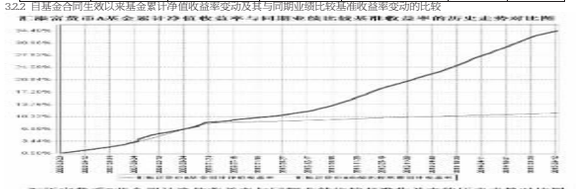
汇添富货币C

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	0.5994%	0.0006%	0.0882%	0.0000%	0.5112%	0.0006%

汇添富货币D

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	0.5994%	0.0006%	0.0882%	0.0000%	0.5112%	0.0006%

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:1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2006年3月23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。

2、本基金从本《基金合同》生效之日起至2009年2月15日采用的业绩比较基准为同期税后一年定期存款利率。从2009年2月16日起,本基金业绩比较基准为同期税后活期存款利率。

§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		
汤从珊	汇添富货币基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金、汇添富和聚宝货币基金、汇添富添富通货币基金的基金经理。	2013年7月31日	-	7年	国籍:中国,学历:上海财经大学管理学硕士。相关业务资格:基金从业资格。从业经历:曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。2007年8月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任固定收益高级经理,固定收益基金经理助理,现任固定收益投资总监。2008年3月6日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理,2009年1月21日至2011年6月21日任汇添富货币基金的基金经理,2011年1月26日至2013年2月7日任汇添富保本混合基金的基金经理,2012年7月26日至今任汇添富季季红定期开放债券基金的基金经理,2013年11月6日至今任汇添富互利分级债券基金的基金经理,2013年12月13日至2015年3月31日任汇添富全额宝货币基金的基金经理,2014年1月21日至2015年3月31日任汇添富收益快钱货币基金的基金经理,2014年12月23日至今任汇添富收益快钱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

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1次,是由于合规控制原因调整导致。经检查和分析未发现异常情况。

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

2015三季度经济下行压力仍然较大,央行维持较为宽松的货币政策,资金利率低位运行。7月以来,由于半年末效应消除,打新暂停,部分打新资金暂时重回债市,市场资金面步入宽松,同时股市表现差强人意使得投资者风险偏好降低,腾挪出部分仓位配置短期信用债;短融收益率和存款利率快速下行,信用利差迅速压缩。8月,由于11日央行调整人民币中间价形成机制,导致人民币汇率出现大幅贬值,资金流出压力较大,资金成本在中旬以后逐步走高,且存款利率和同业拆借收益率也在到达低位后开始反弹,出现利率的小高点。9月以来,由于降准的效用体现,央行对较为宽松的货币环境的呵护,资金面较8月底逐步回暖,但季末等因素使得9月下旬也出现了不错的投资机会。

本基金在报告期安排了较大比例的流动性于月末、季末等可能发生流动性紧张的时点滚动操作,在短融收益率高企的时点战略性建仓,并持续改善组合持仓中短融的流动性。通过短融的波段性操作和合理错配存款到期日,在保证组合整体流动性的前提下,抓住资金利率高企的时间窗口锁定高息存款和优质短融提高组合收益率。通过这些前瞻性的操作,本基金有效应对了组合的规模变化,确保了组合的流动性和闲置资金合规运作,并抓住关键时点锁定了一部分较高收益的同业存款和短期债券获取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

三季度本基金A级净值收益率为0.5994%,B级净值收益率为0.6606%,C级净值收益率为0.5994%,D级净值收益率为0.5994%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年四季度,国内经济下行的压力仍然较大,内需弱势未改,外需改善有限,需要政策继续宽松护航,同时美国经济复苏不及预期,市场预期美国加息节奏将放缓,同时人民币汇率近期趋于稳定,在政府的强势维稳下,继续贬值的概率不大,热钱流出的速度将显著放缓,资金利率稳定在较为宽松的水平,对债市整体有利,但需要密观察经济复苏的情况以判断货币政策放松的幅度和速度。

同时,由于货币市场可能面临IPO重启、风险资产配置意愿增强、汇率贬值资金外流等事件的冲击,且下半年资金面相对上半年更为谨慎,如果市场情绪过于乐观,需要防范资金的超预期收紧带来的收益率波动。近期英利中票、雨润中票、中钢债等信用事件频发,刚兑打破的历史趋势未变且有加速之势,利于无风险利率的进一步下行。而当前信用利差保护不足,信用债投资需仔细排雷,配置以中高等级为主,严防信用风险。

有鉴于此,本基金将在密切跟踪基本面、政策面和资金面前提下,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,保持组合的较高流动性和安全性,积极把握市场结构性机会,通过在合适的时点锁定高收益的存款和灵活控制短融仓位博取资本利得收入为投资者创造更多额外收益。

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	3,783,625,696.24	21.80
	其中:债券	3,783,625,696.24	21.80
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	339,741,104.41	1.96
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	49,839,949.56	0.29
3	银行存款和结算备付金合计	13,142,639,240.89	75.73
4	其他资产	87,572,274.14	0.50
5	合计	17,353,578,315.68	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	1.79	
	其中:买断式回购融资	-	
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: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	78
报告期内投资组合平均剩余期限最高	78
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	38

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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180天。

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	41.09	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.22	-
2	30天(含)-60天	14.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	8.50	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	19.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.85	-
5	180天(含)-397天(含)	15.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.59	-

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	1,327,706,007.31	7.66
	其中:政策性金融债	1,327,706,007.31	7.66
4	企业债券	110,096,706.66	0.63
5	企业短期融资券	2,149,340,363.22	12.40
6	中期票据	-	-
7	同业存单	196,482,619.05	1.13
8	其他	-	-
9	合计	3,783,625,696.24	21.82
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	186,023,719.65	1.07

5.5 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	150206	15国开06	2,900,000	291,006,876.43	1.68
2	150413	15农发13	2,500,000	250,012,766.72	1.44
3	011567002	15神华能源SCP002	2,000,000	199,956,305.50	1.15
4	150301	15进出01	1,500,000	150,184,962.76	0.87
5	120227	12国开27	1,500,000	147,817,262.74	0.85
6	150211	15国开11	1,000,000	100,383,452.20	0.58
7	150215	15国开15	1,000,000	100,040,950.85	0.58
8	150202	15国开02	1,000,000	100,029,673.83	0.58
9	041551027	15深能源CP001	1,000,000	99,970,221.20	0.58
10	011524005	15中冶SCP005	1,000,000	99,966,625.73	0.58

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	0.1020%
报告期内偏离度的最低值	0.0569%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0737%

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

本报告期内货币市场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、处罚的情况。

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	-
3	应收利息	82,114,882.70
4	应收申购款	5,457,391.44
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	87,572,274.14

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	基金合同生效日(2006年3月23日)基金份额总额	报告期期初基金份额总额	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	报告期期末基金份额总额
汇添富货币A	4,104,914,022.13	323,772,452.06	709,307,249.90	709,579,253.48	323,500,448.48
汇添富货币B	-	3,985,703,985.59	21,841,169,130.71	15,694,752,668.69	10,132,120,447.61
汇添富货币C	-	8,783,607,539.25	39,595,330,243.82	41,804,611,573.23	6,574,326,209.84
汇添富货币D	-	360,507,451.64	478,575,494.85	530,527,725.46	308,555,221.03

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富货币市场基金募集的文件;

2、《汇添富货币市场基金基金合同》;

3、《汇添富货币市场基金托管协议》;

4、《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、报告期内汇添富货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告;

7、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理股份有限公司

8.3 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
2015年10月27日

汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富季季红定期开放债券
场内简称	添富季红
交易代码	164702
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月26日
报告期末基金份额总额	412,973,122.96份
投资目标	本基金主要投资于债券类固定收益品种,在严格管理投资风险的基础上,追求资产的长期