汇添富高息债债券型证券投资基金

【2014】第一季度报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富高息债债券	
交易代码	000174	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年6月27日	
报告期末基金份额总额	128,888,472.89份	
投资目标	本基金以高息债为主要投资对象,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力争实现资产的稳健增值。	
投资策略	本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%;其中对高息债的投资比例不低于非现金基金资产的80%,高息债指信用评级在AA+(含AA+)和A(含A)之间的债券以及法律法规或监管机构未强制要求评级的债券类金融工具;基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。	
业绩比较基准	中债综合指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	汇添富高息债A	汇添富高息债C
下属两级基金的交易代码	000174	000175
报告期末下属两级基金的份额总额	99,404,565.76份	29,483,907.13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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)	
	汇添富高息债A	汇添富高息债C
1.本期已实现收益	1,188,379.95	326,526.15
2.本期利润	1,412,561.98	399,044.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0117	0.0104
4.期末基金资产净值	102,933,448.08	30,415,236.91
5.期末基金份额净值	1.036	1.032

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

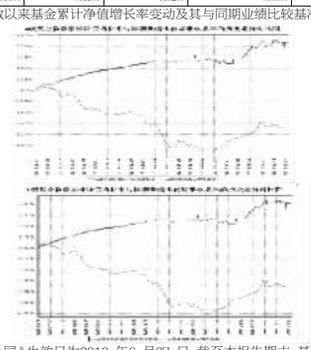
汇添富高息债A

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	1.27%	0.14%	1.62%	0.08%	-0.35%	0.06%

汇添富高息债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	1.18%	0.13%	1.62%	0.08%	-0.44%	0.05%

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:本基金的《基金合同》生效日为2013年6月27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(2013年6月27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		
陈加荣	汇添富理财14天债券基金的基金经理助理,汇添富收益快线货币基金、汇添富双利债券基金、汇添富信用债债券基金、汇添富高息债债券基金、汇添富年年利定期开放债券基金的基金经理。	2013年6月27日	-	13年	国籍:中国。学历:天津大学管理工程硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾在中国平安集团任债券研究员、交易员及本外币投资经理,国联安基金公司任基金经理助理、债券组合经理,农银汇理基金公司任固定收益投资负责人。2008年12月23日到2011年3月2日任农银汇理恒久增利债券基金的基金经理,2009年4月2日到2010年5月9日任农银汇理平衡双利混合基金的基金经理。2012年3月加入汇添富基金管理股份有限公司任金融工程部高级经理,2012年7月10日至今任汇添富理财14天债券基金的基金经理助理,2012年12月21日至2014年1月21日任汇添富收益快线货币基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富双利债券基金的基金经理,2013年6月27日至今任汇添富高息债债券基金的基金经理,2013年9月6日至今任汇添富年年利定期开放债券基金的基金经理。

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11次,原因为对冲专户采取指数化策略投资导致,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

2014年1季度,债券市场的走势再次证明央行态度及资金面的宽松与否仍是目前影响债券市场的最大因素。尽管经济基本面并未出现很大的变化,主要投资机构在"非标"上的投资热情也未见明显减退,1月中下旬,伴随央行为有效管控春节临近前的资金紧张而大量向市场逆回购资金,以及人民币汇率改革中可能的资金投放,市场资金利率开始下行,2013年下半年大幅下跌后收益率处于历史高位的债券市场应声开始反弹,利率债先行,高评级信用债随后跟进。到2月底3月初,银行间7天回购利率下降200bp,10年国债收益率下降15个bp,5年评级AA+的交易所公司债收益率下行70bp。之后,由于央行开始延长正回购期限并加大资金回笼的力度,资金利率开始上行,市场预期相应开始调整,超日债的违约预告,则导致债市全面走弱。至季末,利率债、信用债收益率均有不同程度的上行。

本基金在避开去年市场的大幅下挫后,新年开始继续基于稳健操作的原则,1月末适当增持利率债,并在后期进行了减持。收益稳定增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年一季度本基金A级净值收益率为1.27%,C级净值收益率为1.18%,同期业绩比较基准收益率为1.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在"有保底的改革"的大的方针指引下,未来经济不会太差,市场资金面也不会再次出现类似去年6月末的情境,但较过去,个别的信用风险的暴露将更可能较多出现。在市场整体收益率仍处较高位置的情况下,总体上债券投资价值值得关注。本基金将根据经济、政策的变化,及时调整组合结构,努力降低波动,优选信用相对可靠的高收益的信用债进行积极投资,努力为投资者创造相对稳健的回报。

§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	固定收益投资	169,136,581.25	93.37
	其中:债券	169,136,581.25	93.37
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,289,711.20	2.92
7	其他资产	6,717,412.12	3.71
8	合计	181,143,704.57	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

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:本基金本报告期末未持有股票。

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	40,169,000.00	30.12
	其中:政策性金融债	40,169,000.00	30.12
4	企业债券	126,135,261.25	94.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,832,320.00	2.12
8	其他	-	-
9	合计	169,136,581.25	126.84

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(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140203	14国开03	200,000	20,182,000.00	15.13
2	124402	13丹投01	150,010	14,879,491.90	11.16
3	122276	13魏桥01	103,000	10,063,100.00	7.55
4	130218	13国开18	100,000	10,000,000.00	7.50
4	123012	13哈高新债	100,000	10,000,000.00	7.50
4	124409	13宿城投	100,000	10,000,000.00	7.50
4	124337	13铜建投	100,000	10,000,000.00	7.50
5	140409	14农发09	100,000	9,987,000.00	7.49

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

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本基金报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,807.30
2	应收证券清算款	2,696,787.12
3	应收股利	-
4	应收利息	4,012,227.60
5	应收申购款	3,590.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,717,412.12

5.10.4 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	2,832,320.00	2.12

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

项目	汇添富高息债A	汇添富高息债C
报告期期初基金份额总额	143,650,454.60	54,629,915.67
报告期期间基金总申购份额	20,192,047.77	3,546,308.40
减:报告期期间基金总赎回份额	64,437,936.61	28,692,316.94
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	99,404,565.76	29,483,907.13

§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公司管理的基金。

§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高息债债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富高息债债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富高息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、报告期内汇添富高息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。

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
2014年4月22日

汇添富美丽30股票型证券投资基金

【2014】第一季度报告

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:2014年4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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富美丽30股票
交易代码	000173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月25日
报告期末基金份额总额	1,402,752,612.44份
投资目标	本基金通过精选个股和集中投资,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金为股票型基金。股票投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险;个股精选策略用于挖掘拥有优秀管理层、盈利能力高于行业平均水平、增长可持续且估值水平相对合理的优质上市公司,辅以严格的风险管理,以获得中长期的较高投资收益。投资策略的重点是个股精选策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	15,953,085.86
2.本期利润	28,518,149.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.0347
4.期末基金资产净值	1,648,980,432.53
5.期末基金份额净值	1.176

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。

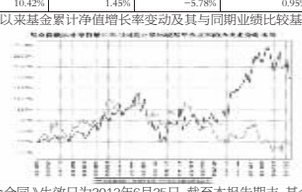
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	10.42%	1.45%	-5.78%	0.95%	16.20%	0.50%

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:注:本基金的《基金合同》生效日为2013年6月25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(2013年6月25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		
王栩	汇添富优势精选混合基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富美丽30股票基金的基金经理。	2013年6月25日	-	12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:曾任上海永盈投资管理有限公司研究员,2004年11月加入汇添富基金管理股份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基金的基金经理,2010年9月21日至2013年5月10日任汇添富医药保健股票基金的基金经理,2012年7月10日至今任汇添富理财14天债券基金的基金经理,2013年6月25日至今任汇添富美丽30股票基金的基金经理。

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,原因为对冲专户采取指数化策略投资导致,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

2014年一季度国内经济增速进一步下滑,内需持续低迷,而美国、欧盟等发达国家的复苏也未带动出口的增长。经济的持续下滑以及央行紧缩表外融资的努力使得国内企业的经营环境大幅恶化,重大债务违约事件已经开始零星出现,投资者对于宏观经济的悲观预期也达到高点。流动性方面,央行着力于维持市场的稳定,商业银行普遍缩减表外融资的规模,一季度货币市场利率相对于去年四季度明显下降,但对于投资者而言这并不足以抵消宏观经济下滑的负面影响。国际方面,美联储正式启动QE缩减进程,今年以来已经将每月的购债规模减少了200亿美元,对全球的风险资产价格都形成负面影响。一季度A股市场整体大幅下跌,但风格资产差异显著。沪深300下跌7.9%,中小板指数上涨0.3%,创业板指数上涨1.8%。分行业来看,信息服务、信息设备、机械设备、综合、餐饮旅游等行业逆市上涨,采掘、农林牧渔、家用电器、黑色金属、商业贸易等行业则大幅下跌。

本基金在一季度根据经济和市场环境的变化对资产配置结构做出调整。股票资产比例较2013年末有所下降,从87.1%下降至81.6%,行业配置方面,主要增持了商业贸易、食品饮料、交运设备等行业,主要减持了公用事业、信息设备、化工、家用电器等行业。个股投资上重点增持了传统消费品行业中竞争力突出的优质个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年1季度本基金的收益率为10.42%,比业绩比较基准高16.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度,本基金的观点如下。第一,在信托、房地产和债券市场等领域都出现债务违约事件之后,中央政府已经表露出稳增长的态度,二季度的经济环境将有所改善。第二,目前中国仍处于去杠杆阶段,但在经济增速和通胀率双双处于低位的情况下,货币政策预计会稍有放松,流动性环境相对于一季度可能进一步改善。第三,IPO的重启已经对小市值公司的估值水平产生结构性冲击,预计这一影响仍将持续。

本基金在二季度重点关注以下方面的投资机会。第一,传统的医药、食品饮料等长期成长性行业在一季度遭到大规模抛售,部分优质公司已经明显低估。第二,随着环保执法力度的加大,高污染行业的供给格局正在发生深刻变化,其中环保技术领先的公司将显著受益于这一趋势。第三,新能源汽车在未来几年将迎来爆发式增长期,产业链中具有核心竞争力的公司有望给投资者带来丰厚的回报。

§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	1,346,174,944.99	78.04
	其中:股票	1,346,174,944.99	78.04
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	50,000,000.00	2.90
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	200,067,749.06	11.60
7	其他资产	128,803,648.88	7.47
8	合计	1,725,046,342.93	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	949,522,167.47	57.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,395,000.00	0.81
E	建筑业	34,187,536.02	2.07
F	批发和零售业	148,776,641.60	9.02
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	15,542,240.12	0.94
J	金融业	-	-
K	房地产业	53,585,721.03	3.25
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	110,885,638.75	6.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,280,000.00	1.23
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,346,174,944.99	81.64

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	300144	宋城股份	4,553,825	110,885,638.75	6.72
2	000858	五粮液	5,470,000	91,184,900.00	5.53
3	002390	信邦制药	1,800,000	86,580,000.00	5.25
4	600352	浙江龙盛	4,100,000	66,666,000.00	4.04
5	000906	物产中拓	5,225,374	64,272,100.20	3.90
6	002242	九阳股份	4,621,018	52,263,713.58	3.17
7	600418	江淮汽车	5,000,000	51,000,000.00	3.09
8	000716	南方食品	3,917,615	50,145,472.00	3.04
9	000919	金陵药业	3,983,663	49,795,787.50	3.02
10	600594	益佰制药	1,001,998	41,031,818.10	2.49

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

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。

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投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

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。

5.11.2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	640,760.72
2	应收证券清算款	96,748,521.32
3	应收股利	-
4	应收利息	81,062.41
5	应收申购款	31,333,304.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	128,803,648.88

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有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:本基金本报告期末前十名股票中未有流通受限股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	730,668,586.86
报告期期间基金总申购份额	1,887,207,770.68
减:报告期期间基金总赎回份额	1,215,123,745.10
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	1,402,752,612.44

§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公司管理的基金。

§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美丽30股票型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富美丽30股票型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富美丽30股票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、报告期内汇添富美丽30股票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。

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
2014年4月22日

汇添富实业债债券型证券投资基金

【2014】第一季度报告

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:2014年4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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富实业债债券	
交易代码	000122	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年6月14日	
报告期末基金份额总额	385,409,376.54份	
投资目标	在严格管理风险和保持资产流动性的基础上,努力实现资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%;其中对实业债的投资比例不低于债券类资产的80%,实业债指以生产制造和基础设施为主业的企业所发行的债券,包括公司债、企业债(含城投债)、可转换债券、可分离债券、短期融资券(不含金融企业短期融资券)、中期票据和中小企业私募债券;基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。	
业绩比较基准	中债综合指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	汇添富实业债债券A	汇添富实业债债券C
下属两级基金的交易代码	000122	000123
报告期末下属两级基金的份额总额	314,893,557.36份	70,515,819.18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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)	
	汇添富实业债债券A	汇添富实业债债券C
1.本期已实现收益	-3,247,153.69	-827,183.34
2.本期利润	1,716,725.51	-16,746.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.0039	-0.0002
4.期末基金资产净值	320,743,770.61	71,554,735.75
5.期末基金份额净值	1.019	1.015

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

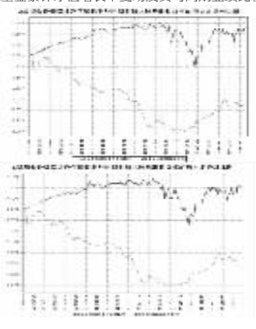
汇添富实业债债券A

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	0.59%	0.26%	1.62%	0.08%	-1.03%	0.18%

汇添富实业债债券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	0.50%	0.26%	1.62%	0.08%	-1.12%	0.18%

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:本基金的《基金合同》生效日为2013年6月14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(2013年6月14日)起6个月,建仓期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