汇添富现金宝货币市场基金

【2014】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:2014年10月24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10月22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	汇添富现金宝货币
交易代码	000330
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月12日
报告期末基金份额总额	28,627,498,107.99份
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。
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7月1日 - 2014年9月30日)
1. 本期已实现收益	330,721,205.00
2.本期利润	330,721,205.00
3.期末基金资产净值	28,627,498,107.99

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。

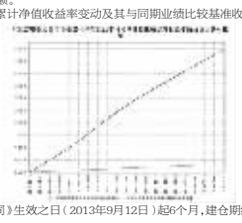
3.2 基金净值表现

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

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	1.1041%	0.0006%	0.0882%	0.0000%	1.0159%	0.0006%

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:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年9月12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。

§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		
曾期	汇添富理财14天的基金经理助理,汇添富理财28天、理财21天、理财7天、汇添富多元收益、可转换债券、现金宝货币、双利增强债券的基金经理,固定收益投资副总监。	2013年9月12日	-	13年	国籍:中国。学历:中国科技大学学士,清华大学MBA。业务资格:基金从业资格。从业经历:曾在红塔证券、汉唐证券、华宝兴业基金负责宏观经济和债券的研究,2008年5月15日至2010年2月5日任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日任华富强化回报基金的基金经理。2011年11月加入汇添富基金任金融工程部高级经理,现任固定收益投资副总监,2012年5月9日至2014年1月21日任汇添富理财30天基金的基金经理,2012年6月12日至2014年1月21日任汇添富理财60天基金的基金经理,2012年7月10日至今任汇添富理财14天基金的基金经理助理,2012年9月18日至今任汇添富多元收益基金的基金经理,2012年10月18日至2014年9月17日任汇添富理财28天基金的基金经理,2013年1月24日至今任汇添富理财21天基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理,2013年5月29日至今任汇添富理财7天基金的基金经理,2013年6月14日至今任汇添富实业债基金的基金经理,2013年9月12至今任汇添富现金宝货币基金的基金经理,2013年12月3日至今任汇添富双利增强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。

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

纵观三季度全球经济,发达国家走向分化,美英领先经济复苏格局,但仍存在一定压力,欧日则尚没有显著改善。同时全球经济形势对于国内出口提振有限,新兴市场国家可能进一步面临资金流出的挑战。国内经济来看,三季度经济遭遇了拐点,增长动能有所放缓。在全面放水之前,预计经济将持续平稳缓慢下行态势。而就目前来看,全面宽松距离尚远。同时第三季度央行在货币政策方面有所主动作为,采取多种手段致力于降低实体经济融资成本,同时进一步扩大定向降息范围,保持适度流动性,实现货币信贷及社会融资规模合理增长。

在基本面大幅弱于预期的驱动下,三季度债券市场收益率继续下行,长端利率下行幅度更大,带动收益率曲线进一步平坦化;受风险情绪上行影响,高收益债券收益率自7月末起重拾下行趋势,表现较好。流动性在持续宽松的大背景下,短端利率继续平稳下行,存款利率维持在较低水平。

本基金规模在三季度小幅下降,一方面受定存和现券收益下降的影响,组合收益率逐步走低,另一方面也受到新股发行的冲击。三季度在保持了合理流动性的前提下,本基金在操作上更为积极,增配了短融等票息较高的资产,同时在关键时点锁定了1-3个月的高收益存款,为持有人获取了更好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年三季度本基金净值收益率为1.1041%,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2014年四季度,国际主要央行货币政策走势分化。一方面,为刺激经济增长,欧央行货币政策料进一步宽松;另一方面,虽然美联储继续奉行低利率货币政策,但由于美国经济复苏动能增强,美元汇率料进一步走强。分析国内情况,2014年房地产市场开始自发性调整,将对四季度和明年一季度的经济增长产生拖累;货币增速和产出缺口处于低位将抑制通胀。四季度外汇占款可能回升、财政存款将大规模投放,资金有望净供给;宏观经济仍需要"稳增长",因此央行在操作上仍将会"保持适度流动性",此外,需要关注四季度信用风险局部暴露的可能性。

我们将综合分析本基金的份额变动,做好债券与存款之间的配置与转换。在保持做好期限匹配管理的同时,择机把握中高等级短融的波动机会,适度提高组合的投资收益。

§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	8,821,529,545.43	30.61
	其中:债券	8,821,529,545.43	30.61
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	430,001,165.00	1.49
	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	19,184,345,813.94	66.56
4	其他资产	385,781,877.54	1.34
5	合计	28,821,658,401.91	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	1.30	
	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	179,999,610.00	0.63
	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	105
	报告期内投资组合平均剩余期限最高值	114
	报告期内投资组合平均剩余期限最低值	82

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120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	24.75	0.63
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.21	-
2	30天(含)-60天	25.46	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.42	-
3	60天(含)-90天	5.92	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.30	-
4	90天(含)-180天	27.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.58	-
5	180天(含)-397天(含)	15.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.33	0.63

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	2,527,034,386.61	8.83
	其中:政策性金融债	2,527,034,386.61	8.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	6,294,495,158.82	21.99
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	8,821,529,545.43	30.81
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	718,062,866.17	2.51

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	140207	14国开07	3,600,000	360,771,471.24	1.26
2	140437	14农发37	2,500,000	249,768,498.50	0.87
3	130241	13国开41	2,100,000	211,025,673.87	0.74
4	011476001	14京投SCP001	2,000,000	200,424,363.49	0.70
5	011437005	14中建材SCP005	2,000,000	200,372,209.72	0.70
6	130327	13进出27	2,000,000	199,994,784.95	0.70
7	041477001	14国电集CP002	1,800,000	181,033,962.42	0.63
8	041455003	14金鼎CP001	1,800,000	180,986,347.28	0.63
9	120227	12国开27	1,700,000	167,402,709.55	0.58
10	041364047	13青岛城投CP002	1,500,000	151,055,919.92	0.53

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	0.1207%
报告期内偏离度的最低值	0.0307%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0778%

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	-
3	应收利息	385,751,877.54
4	应收申购款	-
5	其他应收款	30,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	385,781,877.54

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	28,244,936,193.20
报告期期间基金总申购份额	85,789,580,766.85
减:报告期期间基金总赎回份额	85,407,018,852.06
报告期期末基金份额总额	28,627,498,107.99

§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

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2014年8月7日	25,000,000.00	25,000,000.00	-
2	申购	2014年8月26日	20,000,000.00	20,000,000.00	-
3	申购	2014年9月26日	25,000,000.00	25,000,000.00	-
合计			70,000,000.00	70,000,000.00	

§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现金宝货币市场基金募集的文件;
2、《汇添富现金宝货币市场基金基金合同》;
3、《汇添富现金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、报告期内汇添富现金宝货币市场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10月24日

汇添富新收益债券证券投资基金

【2014】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:2014年10月24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10月22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	汇添富新收益债券
交易代码	000366
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月10日
报告期末基金份额总额	47,641,762.77份
投资目标	本基金主要投资于债券资产,在承担合理风险和保持资产流动性的基础上适度参与权益类品种投资,力争实现资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;股票资产的投资比例合计不超过基金资产的20%,其中基金持有的金部权证的市值不超过基金资产净值的3%,持有的现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金通过参与一级市场新股申购、股票增发,以及因所持股票进行股票配售及派发所形成的股票,不超过基金资产的20%;本基金通过二级市场直接买入股票或权证,所占比例不超过基金资产的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7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	608,675.31
2.本期利润	1,111,523.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0194
4.期末基金资产净值	49,789,213.03
5.期末基金份额净值	1.045

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。

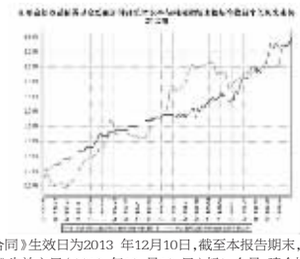
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.95%	0.10%	0.70%	0.07%	1.25%	0.03%

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12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(2013年12月10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。

§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		
梁珂	汇添富可转换债券基金、汇添富新收益债券基金的基金经理。	2013年12月11日	-	6年	国籍:中国。学历:北京大学概率论及数理统计学学士、硕士,经济学双学位。相关业务资格:基金从业资格,特许金融分析师(CFA)。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理。2012年11月加入汇添富基金管理股份有限公司从事固定收益研究。2013年3月28日至今任汇添富可转换债券债券的基金经理,2013年12月10日至今任汇添富新收益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1次,由于专户到期清盘导致。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

恰如此前我们在基金定期报告中指出的,政策托底的力量在三季度明显增强,定向的货币政策以及结构性的财政政策和产业政策层出不穷,推动各类资产均有较好表现。特别我们准确预判了纯债类资产向偏权益资产的加速轮动,这一阶段A股市场不同类型、不同风格、各个板块的资产轮动上涨,也为本基金提高杠杆,为投资者赢取收益提供了难得的机会。

具体来看,整个三季度,中债综合财富指数上涨幅1.65%,转债市场在转股价值推动下涨幅达到5.36%,沪深300指数期间大幅上涨13.2%。

本基金在报告期内以对流动性风险的控制为首要目标,并基于对政策环境、宏观经济、公司基本面和市场特征的密切跟踪,择取优质个券进行了适度集中配置,同时通过积极的波段操作提高了组合收益,但受制于流动性压力及投资范围的临时受限,未能通过更激进的操作进一步扩大投资成果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年三季度本基金净值收益率为1.95%,同期业绩比较基准收益率为0.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

延续此前判断,我们仍然认为,在转型期的政策环境下,经济增速中枢的稳步下行顺理成章,并不会构成实体经济和资本市场的主要风险,管理层的底线思维将继续凸显,毕竟经济的适度增长仍是民生就业持续改善的必要条件。特别是三季度宏观数据体现出承受了更明显的下降压力,我们判断政策的调整幅度在四季度很可能将进一步放大,我们也将继续重点关注货币政策、财政政策、产业政策的变化以及资本市场改革对于市场本身的影响。

对于市场的判断方面,我们继续认为纯债类资产向偏权益资产轮动的过程仍未结束,但货币政策宽松预期延续的前提下,这一轮动过程并不意味着债券,特别是非信用品种投资机会的终结。不过,需要指出的是,虽然大的方向已经清晰,但短期内还是需要防范企业盈利滞后下滑以及局部风险引爆降低市场风险偏好的可能。

组合运作上,我们仍将以控制组合收益下行风险为优先考量,保持组合资产的良好流动性,并在风险可控前提下阶段性通过转债为代表的偏权益资产为组合赢取超额收益。此外,我们仍会在密切跟踪基本面、政策面和资金面前提下保持组合操作灵活性,并结合一级市场的最新发展,努力通过一二级市场套利交易为投资者增厚投资回报。

§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	64,954,076.50	94.08
	其中:债券	64,954,076.50	94.08
	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	2,182,643.50	3.16
7	其他资产	1,906,182.08	2.76
8	合计	69,042,902.08	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	5,090,000.00	10.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,570,160.00	41.32
	其中:政策性金融债	20,570,160.00	41.32
4	企业债券	36,438,229.00	73.18
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,855,687.50	5.74
8	其他	-	-
9	合计	64,954,076.50	130.46

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	018003	国开1401	97,770	10,559,160.00	21.21
2	112083	11国星债	100,000	10,080,000.00	20.25
3	140212	14国开12	100,000	10,011,000.00	20.11
4	122108	11新天01	100,000	10,000,000.00	20.08
5	126019	09长虹债	84,540	8,179,245.00	16.43

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:本基金本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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,189.13
2	应收证券清算款	488,000.73
3	应收股利	-
4	应收利息	1,348,040.27
5	应收申购款	57,951.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,906,182.08

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	113001	中行转债	1,035,600.00	2.08
2	110024	隧道转债	307,382.40	0.62

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

报告期期初基金份额总额	71,901,469.83
报告期期间基金总申购份额	1,728,033.88
减:报告期期间基金总赎回份额	25,987,740.94
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	47,641,762.77

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:本基金的基金管理人本报告期内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新收益债券型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富新收益债券型证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富新收益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、报告期内汇添富新收益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10月24日

汇添富优势精选混合型证券投资基金

【2014】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:2014年10月24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10月22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	汇添富优势精选混合
交易代码	519008
前端交易代码	519008
后端交易代码	519009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年8月25日
报告期末基金份额总额	1,024,772,395.45份
投资目标	投资具有持续竞争优势的企业,分享其在中国经济持续高速成长背景下的长期优异业绩,为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采用适度动态资产配置策略,同时运用汇添富持续竞争优势企业评估系统自下而上精选个股,并对投资组合进行积极而有效的风险管理。
业绩比较基准	70%×沪深300指数收益率+30%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金是精选股票、并且进行积极风险控制的混合型基金,本基金的风险和预期收益比较均衡,在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	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7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	63,557,518.94
2.本期利润	246,224,443.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.2396
4.期末基金资产净值	2,894,111,470.26
5.期末基金份额净值	2.8242

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	9.27%	0.82%	9.58%	0.63%	-0.31%	0.19%

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(2005年8月25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。

§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。	2010年2月5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