汇添富理财7天债券型证券投资基金

2014 年度报告摘要

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
送出日期:2015年3月31日

§1 重要提示

1.1 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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富理财7天债券	
基金主代码	471007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年5月29日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	774,243,105.03份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B
下属分级基金的交易代码:	471007	472007
报告期末下属分级基金的份额总额	618,280,814.60份	155,962,290.43份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全,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控制在127天内。在控制利率风险的,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,高于货币市场型证券投资基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	蒋松云
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年		2013年5月29日(基金合同生效日)-2013年12月31日	
	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B
本期已实现收益	39,201,883.35	11,251,206.10	60,388,873.95	12,926,123.76
本期利润	39,201,883.35	11,251,206.10	60,388,873.95	12,926,123.76
本期净值收益率	4.7642%	5.2255%	3.0025%	3.2716%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末		2013年末	
期末基金资产净值	618,280,814.60	155,962,290.43	1,350,550,967.18	150,043,600.77
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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、上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(例如:基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金的《基金合同》生效日为2013年5月29日,至本报告期末未满三年,因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2014年12月31日数据,特此说明。

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

汇添富理财7天债券A

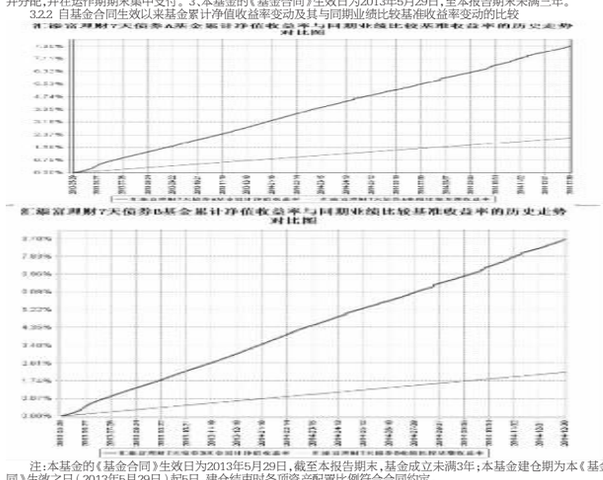
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1764%	0.0099%	0.3403%	0.0000%	0.8361%	0.0099%
过去六个月	2.3865%	0.0107%	0.6805%	0.0000%	1.7060%	0.0107%
过去一年	4.7642%	0.0083%	1.3500%	0.0000%	3.4142%	0.0083%
自基金合同生效日起至今	7.9098%	0.0069%	2.1634%	0.0000%	5.7464%	0.0069%

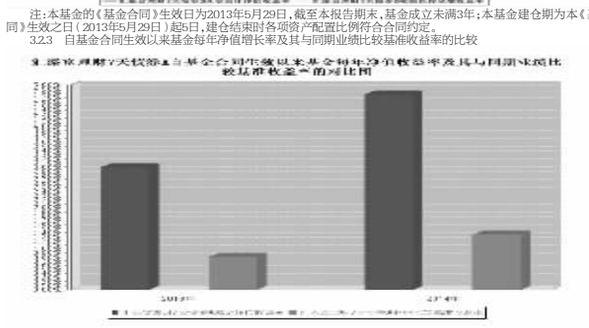
汇添富理财7天债券B

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	1.2884%	0.0099%	0.3403%	0.0000%	0.9481%	0.0099%
过去六个月	2.6137%	0.0107%	0.6805%	0.0000%	1.9332%	0.0107%
过去一年	5.2255%	0.0083%	1.3500%	0.0000%	3.8755%	0.0083%
自基金合同生效日起至今	8.6681%	0.0069%	2.1634%	0.0000%	6.5047%	0.0069%

注:1、表格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、本基金的《基金合同》生效日为2013年5月29日,至本报告期末未满三年。

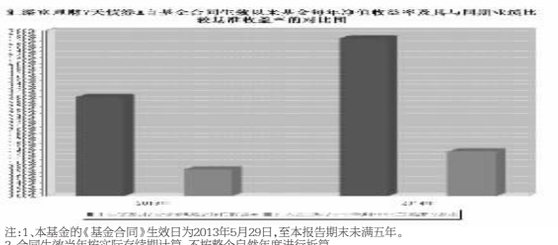
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:本基金的《基金合同》生效日为2013年5月29日,截至本报告期末,基金成立未满3年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年5月29日)起5日,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1、本基金的《基金合同》生效日为2013年5月29日,至本报告期未未满五年。

2、合同生效当年按实际存续期计算,不按整个日然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

汇添富理财7天债券A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014	35,638,456.55	4,113,957.86	-550,531.06	39,201,883.35	
2013	50,544,019.85	8,957,428.71	887,425.39	60,388,873.95	
合计	86,182,476.40	13,071,386.57	336,894.33	99,590,757.30	
汇添富理财7天债券B					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014	9,477,539.49	1,818,431.28	-44,764.67	11,251,206.10	
2013	9,669,896.63	3,139,739.90	116,487.23	12,926,123.76	
合计	19,147,436.12	4,958,171.18	71,722.56	24,177,329.86	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司成立于2005年2月,总部设在上海陆家嘴,公司旗下设立了北京、南方以及上海虹桥机场三个分公司,以及两个子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司 (China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited)和汇添富资本管理有限公司。

汇添富是中国第一批获得QDII业务资格、专户业务资格、设立海外子公司并且获得ROFII业务资格的基金公司,同时是全国社会保障基金投资管理人。在投资管理领域,汇添富已形成公募、专户、国际、养老金四大块业务以及股票、固定收益、被动投资、海外投资、另类投资五大块投资领域协同发展的格局。

截止2014年末,汇添富共管理50只证券投资基金,涵盖股票、指数、QDII、债券、货币市场基金等不同风险收益特征的产品。报告期内,汇添富共发行6只基金产品,包括汇添富恒生指数分级证券投资基金,汇添富和聚宝货币市场基金、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金。

汇添富始终坚持"以企业基本分析为立足点,挑选高质量的证券,把握市场脉络,做中长期投资布局,以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益"这一长期价值投资理念,并在投资研究中坚定有效地贯彻和执行。2014年,汇添富取得了良好的整体投资业绩,准确把握市场节奏,精准布局产品线,旗下基金产品(除QDII产品)成立以来均实现正收益,其中逆向、美丽30、价值、民营等基金位列全市场股票型基金前1/4。

2014年,汇添富专户业务快速发展,积极创新,推出了战略型定增专户、新股投资主题专户、海外市场QDII专户、企业现金管理专户等创新型产品。2014年,公司成功获得包括国内全部大型保险公司在内的多家保险专户资格,获得多个专户组合并取得优异投资业绩。

2014年,汇添富积极协助社保理事会研发新投资品种,参与社保产品设计和攻造,并加强社保组合投资管理工作。目前公司的社保组合已经涵盖了股票、债券等品种,整体投资业绩优良。

2014年,汇添富国际业务继续向前推进,香港子公司各项业务继续顺利推进,并成功发行添富主要消费ROFII ETF和医药ROFII ETF,以及ROFII货币市场基金。同时加强国际机构合作,在北欧、中东都有业务推进。

2014年,汇添富电子商务业务继续坚持"两条腿走路",一方面加强公司官网直销能力优化客户体验,一方面继续加强跨网合作,目前汇添富电商合作伙伴已达11家。2014年,"现金宝"品牌影响力进一步加强,现金宝APP成为下载和使用排名前十位的理财类手机应用中唯一由基金公司开发的应用。

2014年,汇添富资本子公司发展良好,大力开展各类创新业务,推出投掘贷款收益权和供应链融资等创新业务。同时完成了大批规章制度和业务指引的修订,有力地保障公司运营合法有序。公司在2014年还涉足一级市场业务,积极参与了绿地集团增资扩股项目,成为第一家介入一级市场并参与国企改革的公募基金公司。

2014年,汇添富持续开展贴心的投资者服务与教育工作。公司围绕向"现代财富管理机构"转型的思路,从不同类型客户的切身需求出发,大力建设投顾式客户服务体系;同时,公司进一步着力开展"投资者见面会"、"添富之约"客户沙龙、投资者"走进汇添富"和"走进上市公司"等全方位的投资者服务与教育活动。

2014年,汇添富社会责任事业进一步深入开展。"问流?孩子"助学计划启动第七季活动,公司公益基金会捐资在青海省海东地区互助县建设"添富小学";为添富小学校长及优秀乡村教师提供国内外知名教育机构的师资培训;"问流?孩子"公益纪录片成功在全国范围公映;"添富之爱 感恩十年"公益行走遍六所添富小学,让汇添富的业务伙伴更加深入了解了汇添富的感恩文化。

2014年,汇添富荣获了包括金牛基金奖、上海市金融创新二等奖、最佳债券公司奖、上海市五一劳动奖状、模范职工之家等多个重要奖项,行业地位进一步彰显。

展望2015年,是中国改革深化的关键之年,"互联网+"正式写入政府工作报告,财富管理行业也将在互联网和移动互联网的催化之下发生更加剧烈的变化。2015年我们将继续为实现汇添富的梦想奋勇前行、为筑造中国梦添砖加瓦!

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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,理财30天、理财60天、理财28天、理财21天、理财7天、汇添富多元收益、可转换债券、无息债券、现金宝货币、双利增强债券的基金经理,固定收益投资部总监。	2013年5月29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:曾在长城证券、次康证券、华宝兴业基金负责宏观经济和债券的研究,2006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,现任固定收益投资总监,2012年5月9日至2014年4月29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日至今任汇添富宝业债基金的基金经理,2013年9月12日至今任汇添富现金宝的基金经理,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。

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	350,257,881.25	44.43
	其中:债券	350,257,881.25	44.43
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	78,000,757.00	9.89
	其中:买断式回购的买入返售金融	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	351,594,433.97	44.60
4	其他各项资产	8,526,396.37	1.08
5	合计	788,379,468.59	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

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	3.33
	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	12,999,860.50	1.68
	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。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	41

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127 天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

8.3.2 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	33.53	1.68
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	16.04	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.59	-
3	60天(含)-90天	26.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.18	-
4	90天(含)-180天	7.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	16.79	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.73	1.68

8.4 期末投债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	110,197,304.49	14.23
	其中:政策性金融债	110,197,304.49	14.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	240,060,576.76	31.01
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	350,257,881.25	45.24
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	60,196,012.22	7.77

8.5 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

金额单位:人民币元

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	140436	14农发36	500,000	50,001,292.27	6.46
2	090205	09国开05	200,000	20,133,481.08	2.60
3	130212	13国开12	200,000	20,087,405.03	2.59
4	041460004	14梅花CP001	200,000	20,073,924.87	2.59
5	041453078	14南平高速CP002	200,000	20,050,020.60	2.59
6	041462042	14鲁宏桥CP002	200,000	20,000,622.79	2.58
7	041460022	14川铁投CP001	200,000	20,000,520.33	2.58
8	041462027	14东方CP002	200,000	20,000,497.13	2.58
9	041456007	14奇瑞CP001	200,000	20,000,488.10	2.58
10	041451010	14新物产CP001	200,000	20,000,143.31	2.58

8.6 "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	116
报告期内偏离度的最高值	0.4299%
报告期内偏离度的最低值	-0.0701%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2299%

8.7 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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 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。

8.8.3 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。

8.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	8,526,396.37
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	8,526,396.37

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇添富理财7天债券A	11,853	52,162.39	4,953,990.65	0.80%	613,326,823.95	99.20%
汇添富理财7天债券B	11	14,178,390.04	15,905,341.16	10.20%	140,056,949.27	89.80%
合计	11,864	65,259.87	20,859,331.81	2.69%	753,383,773.22	97.31%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富理财7天债券A	46,176.62	0.0075%
	汇添富理财7天债券B	0.00	0.0000%
	合计	46,176.62	0.0060%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富理财7天债券A	0
	汇添富理财7天债券B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富理财7天债券A	0
	汇添富理财7天债券B	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B
基金合同生效日(2013年5月29日)基金份额总额	2,070,253,810.67	915,533,919.40
本报告期期初基金份额总额	1,350,550,967.18	150,043,600.77
本报告期基金总申购份额	4,235,448,523.73	2,077,040,198.12
减:本报告期基金总赎回份额	4,967,718,676.31	2,071,121,508.46
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	618,280,814.60	155,962,290.43

注:总申购份额含红利再投份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人2014年1月23日公告,增聘汤丛珊女士担任汇添富理财30天债券型证券投资基金的基金经理,曾刚先生不再担任该基金的基金经理。

2、基金管理人2014年1月23日公告,增聘汤丛珊女士担任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理,曾刚先生不再担任该基金的基金经理。

3、基金管理人2014年1月23日公告,增聘陆文磊先生担任汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理,陈加荣先生不再担任该基金的基金经理。

4、基金管理人2014年1月23日公告,增聘何旻先生担任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理,与陈加荣先生共同管理该基金。

5、《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》于2014年3月6日正式生效,赖中立先生任该基金的基金经理。

6、基金管理人2014年3月28日公告,增聘雷鸣先生担任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理,与齐东超先生共同管理该基金。

7、基金管理人2014年4月10日公告,增聘朱晓亮先生担任汇添富民营活力股票型证券投资基金的基金经理,齐东超先生不再担任该基金的基金经理。

8、基金管理人2014年4月10日公告,增聘顾耀强先生担任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理,与韩贤旺先生、叶从飞先生、朱晓亮先生共同管理该基金。

9、基金管理人2014年4月10日公告,齐东超先生不再担任汇添富成长焦点股票型证券投资基金的基金经理,由雷鸣先生单独管理该基金。

10、《汇添富和聚宝货币市场基金基金合同》于2014年5月28日正式生效,汤丛珊女士任该基金的基金经理。

11、《汇添富移动互联股票型证券投资基金基金合同》于2014年8月26日正式生效,欧阳沁春先生任该基金的基金经理。

12、《汇添富环保行业股票型证券投资基金基金合同》于2014年9月16日正式生效,叶从飞先生任该基金的基金经理。

13、基金管理人2014年10月25日公告,增聘徐寅喆女士担任汇添富理财7天债券型证券投资基金的基金经理,与曾刚先生共同管理该基金。

14、基金管理人2014年10月25日公告,增聘徐寅喆女士担任汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理,与陆文磊先生共同管理该基金。

15、基金管理人2014年11月27日公告,增聘徐寅喆女士担任汇添富和聚宝货币市场基金的基金经理,与汤丛珊女士共同管理该基金。

16、《汇添富外延增长主题股票型证券投资基金基金合同》于2014年12月8日正式生效,韩贤旺先生任该基金的基金经理。

17、《汇添富收益快钱货币市场基金基金合同》于2014年12月23日正式生效,陆文磊先生、徐寅喆女士共同任该基金的基金经理。

18、本报告期内,因基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称"本行")工作需要,周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理,在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前,由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务投权职责。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)自本基金合同生效日(2013年5月29日)起至本报告期末,为本基金进行审计。本报告期末,应付未付的审计费用为人民币伍万元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	-	-	-	-	-

注:本基金本报告期未通过证券公司交易单元进行股票交易。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	26,500,000.00	100.00%	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1)基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

(2)交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3)投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。

(4)每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5)调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部负责,投资总监审批。

(6)成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7)调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:此2个交易单元与汇添富均衡增长股票型证券投资基金、汇添富理财30天债券型证券投资基金、汇添富年利记期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富互利分级债券证券投资基金和汇添富新收益债券型证券投资基金共用,且均为本基金新增席位。

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注:本基金本期未发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

汇添富基金管理股份有限公司
2015年3月31日

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐国超	汇添富和聚宝货币基金、汇添富收益快钱货币基金、汇添富理财7天债券基金的基金经理。	2014年8月27日	-	6年	国籍:中国,学历:复旦大学法学学士,六年证券从业经验。曾任长江养老保险股份有限公司债券交易员,2012年5月加入汇添富基金管理股份有限公司任债券交易员,固定收益基金经理助理,2014年8月27日至今任汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富理财7天债券型证券投资基金的基金经理。2014年11月26日至今任汇添富和聚宝货币市场基金经理。2014年12月23日至今任汇添富收益快钱货币基金基金经理。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》,本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》,建立了健全、有效的公平交易制度体系,覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合;涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动;贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括:(1)在研究环节,公司建立了统一的投研平台信息管理系统,公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时,通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。(2)在投资环节,公司针对基金、专户、社保分别设立了投资决策委员会,各委员会根据各自议事规则分别召开会议,在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略,独立制定资产配置计划和组合调整方案,并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。(3)在交易环节,公司实行集中交易,所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式,按照"时间优先、价格优先、比例分配"的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理,严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配,确保交易的公平性。(4)在交易监控环节,公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式,对投资交易全过程实施监督,对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。(5)在投后分析方面,公司按季度和年度编制公平交易分析报告,并由投组合经理、督察长、总经理审核签署。同时,投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

4.3.2 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。报告期内,本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度,进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易行为监控体系由稽核监察部、集中交易室、投资研究部组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的监控,确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内,公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下(日内、3日、5日)同向交易的样本,利用统计分析的方法和工具,根据对样本个数、差价率是否为0的T检验显著程度、差价率均值是否小于1%、同向交易占优比等原因进行综合分析,未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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%的交易次数共8次,其中因专户到期清盘发生2次、因基金流动性需要发生3次、因对冲策略发生3次,经检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年,尽管债券市场屡起涟漪,但钱荒后的收益率修复造就了债券牛市。2014年宏观经济以保就业稳增长成为主要核心任务,货币政策基调逐步转向相对宽松,并于11月进行不对称降息。同时定向宽松政策工具不断创新,银行间回购利率逐步下行并保持低位,流动性预期恢复稳定。整体上货币市场利率持续回落,货币基金再投资收益率也逐步回归到正常水平。但临近年末,受到回业存款缴准传言、股票IPO和股市上涨的挤压效应影响,银行间流动性明显紧张,而12月中债登关于地方政府债务清理的新规出进一步挤压资金面,出现了短暂的年末资金紧张。

操作上,本基金受到货币政策持续宽松的影响,债券市场收益率下行显著,短期债券始终保持活跃,由于流动性宽裕,银行存款利率下降速度较快。本基金从一季度开始加大了对债券的配置,降低了银行存款的比例,通过波段操作较好的把握了债券的上涨机会,并在各季末时点关注流动性风险,为投资者取得了较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本期间本基金A级净值收益率为4.7642%,B级净值收益率为5.2255%。

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债券收益率已经回到中性水平,债市走向更加依赖于新增力量的驱动。经济运行处于"三期叠加"的大格局中,周期下行的趋势难以扭转,仍然是债市走牛的驱动力。政策基调大概率不会发生变化,但全国降准降息空间有所扩展,同样可能驱动债券收益率进一步下行。然而,全面深化改革过程中难免转型的阵痛,不论是利率市场化推