汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金

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2014年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21天债券发起式	
基金主代码	470021	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月24日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	70,067,073.43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21天债券发起式A	汇添富理财21天债券发起式B
下属分级基金的交易代码:	470021	471021
报告期末下属分级基金的份额总额	29,155,998.59份	40,911,074.84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141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	本基金属于短期理财债券型证券投资基金,预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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	王永民
	联系电话	021-28932888	010-66594896
	电子邮箱	service@99fund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95566
传真		021-28932998	010-66594942

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层 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1月24日(基金合同生效日)-2013年12月31日		2012年	
	汇添富理财21天债券发起式A	汇添富理财21天债券发起式B	汇添富理财21天债券发起式A	汇添富理财21天债券发起式B	汇添富理财21天债券发起式A	汇添富理财21天债券发起式B
本期已实现收益	1,755,808.18	5,331,339.05	18,278,024.82	11,283,184.33	-	-
本期利润	1,755,808.18	5,331,339.05	18,278,024.82	11,283,184.33	-	-
本期净值收益率	4.4961%	4.7993%	3.5824%	3.8674%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2014年末		2013年末		2012年末	
期末基金资产净值	29,155,998.59	40,911,074.84	45,956,185.12	146,672,667.58	-	-
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、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(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、本基金的《基金合同》生效日为2013年1月24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21天债券发起式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	1.2117%	0.0173%	0.3403%	0.0000%	0.8714%	0.0173%
过去六个月	2.1352%	0.0135%	0.6805%	0.0000%	1.4547%	0.0135%
过去一年	4.4962%	0.0108%	1.3500%	0.0000%	3.1462%	0.0108%
自基金合同生效日起至今	8.2395%	0.0080%	2.6320%	0.0000%	5.6075%	0.0080%

汇添富理财21天债券发起式B

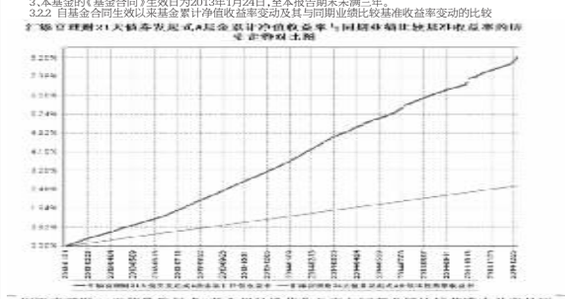
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.2855%	0.0173%	0.3403%	0.0000%	0.9452%	0.0173%
过去六个月	2.2843%	0.0135%	0.6805%	0.0000%	1.6038%	0.0135%
过去一年	4.7995%	0.0108%	1.3500%	0.0000%	3.4495%	0.0108%
自基金合同生效日起至今	8.8524%	0.0080%	2.6320%	0.0000%	6.2204%	0.0080%

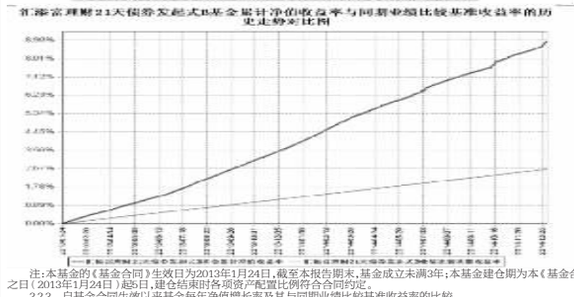
注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。

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、本基金的《基金合同》生效日为2013年1月24日,至本报告期末未满三年。

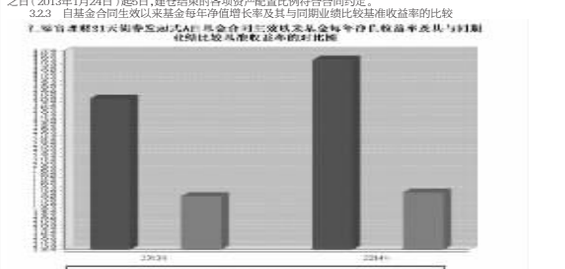
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

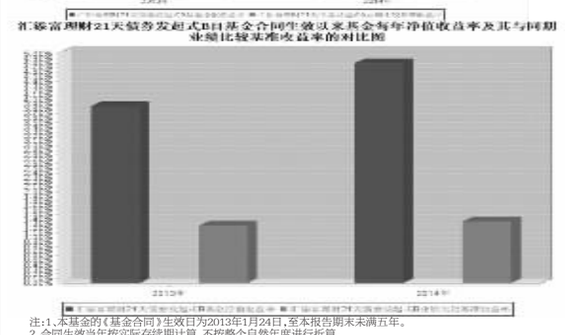




注:本基金的《基金合同》生效日为2013年1月24日,截至本报告期末,基金成立未满3年;本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年1月24日)起5日,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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1月24日,至本报告期末未满五年。

2、合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

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21天债券发起式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	1,350,098.92	386,939.96	18,769.30	1,755,808.18	
2013	9,389,938.56	8,841,318.93	46,767.33	18,278,024.82	
合计	10,740,037.48	9,228,258.89	65,536.63	20,033,833.00	

单位:人民币元

汇添富理财21天债券发起式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	4,210,081.84	1,127,770.78	-6,513.57	5,331,339.05	
2013	6,244,965.90	4,895,091.16	143,127.27	11,283,184.33	
合计	10,455,047.74	6,022,861.94	136,613.70	16,614,523.38	

§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,汇添富和金添利两款互联网货币市场基金,汇添富稳健收益债券型证券投资基金,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,挖选高质量的证券,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改造,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,一方面继续加强跨界合作,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,推出投掷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,汇添富持续开展帮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。"河流?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;"河流?孩子"公益起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		
雷刚	汇添富理财14天债券基金经理助理、理财30天、理财60天、理财90天、理财21天、理财7天、汇添富多元收益、可转换债券、安全增债债券、现金宝货币、双利增强债券基金经理、固定收益投资副总监。	2013年1月24日	-	13年	国籍:中国,学历:中国科技大学学士,清华大学MBA,证券资格,基金从业资格,从业经历:曾在红塔证券、汉唐证券、华宝兴业基金信息安全技术和债券的研究。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11日任华富收益增强基金的基金经理。2010年5月8日至2011年11月11日任华富保证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20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日至今任汇添富现金宝的基金经理,2013年12月31日至今任汇添富短期融资基金的基金经理。
蒋文玲	汇添富现金宝、理财14天、理财21天、理财28天、多元收益债券、实业债债券基金的基金经理助理	2014年4月8日	-	8年	国籍:中国,学历:上海财经大学经济学硕士,证券资格,证券投资基金从业资格,从业经历:曾任汇添富基金汇添富基金债券交易员、债券研究部研究员。2012年11月30日至2014年1月7日任浦银安盛基金货币市场基金的基金经理。2014年1月加入汇添富基金,历任金融工程高级经理、固定收益基金经理助理。2014年4月8日至2014年9月17日任汇添富理财30天债券基金的基金经理助理;2014年4月8日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财28天债券基金、汇添富理财21天债券基金、汇添富多元收益债券基金、汇添富实业债债券基金的基金经理助理。

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)在报告分析方面,公司按季度和年度编制公平交易分析报告,并由投资组合经理、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年债券市场前三季度呈现牛市格局,但是在12月份出现了全面调整,主要原因一方面受股债"跷跷板"的影响,债券市场投资行为受到挤压,另一方面,与今年前三季度资金宽松的局面有所不同,11-12月份资金面和货币市场利率均大幅上行,其中1年期短融的收益率最高达到5.5%,接近年初水平,而同期利率债调整幅度相应较小。

与去年年末相比,本基金规模有所下降,目前已经低于1亿元。受制于规模较小,以及定存和现券收益双双下降的影响,组合收益率逐步走低。与去年相比,今年债券市场信用风险事件频发,并伴随大面积的债券评级下调,因此本基金在债券配置上更为谨慎,减持了大面分AA-债券,替换成AA-AA+等中高等级品种,提高了组合的流动性和安全性,力争为持有人获取更稳定的回报。

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4.4962%,B级本期净值收益率为4.7995%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着以能源为主的大宗商品价格持续下跌,全球主要经济体均处在低通胀环境中。美国通胀继续弱势运行可能性大,日本CPI同比将重回1%以内,欧元区通缩风险加剧,以出口能源为主的新兴经济体则面临较大的通胀压力。在通胀走低以及油价下跌带来的全球不确定性上升的环境中,全球债券收益率近期持续下降,相比之下,中国国债收益率目前仍在历史平均水平上方,而与2012年7月份的低点相比,目前中长端(期限3年以上)高30-40bp,而中短高出的幅度更为明显,中国债券的收益率仍有向下的想象空间。未来值得关注的仍是国内经济数据的表现。如果经济没有有效企稳甚至继续下滑,则可能让伪债券投资者的担忧,货币政策也可能会继续放松,债券在一季度供给压力较小的情况下有望迎来交易性的机会。整体来看,2015年的债市机会大于风险,但是整体的波动将加大,信贷和房地产市场的改善、地方债的供给,以及信用风险事件仍是不可忽视的债市"黑天鹅"。

我们将综合分析本基金的份额持有人结构、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证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,合理搭配回购、同业存款、短融、金融债等品种,力争提高组合收益,同时会针对债券市场风险频发的现状,做好债券资质的筛查,避免出现所投资债券评级下调、到期无法兑现的情况。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,公司以维护基金份额持人利益为宗旨,有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则,认真履行职责,通过常规稽核、专项检查和系统监控等方式方法积极开展工作,强化对基金运作和公司运营的合规性监察,促进内部控制和风险管理的不断改进,并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内,本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面:

(一)完善规章制度,健全内部控制体系

在本报告期内,督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估,并根据各项业务特点、业务发展实际,建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程,进一步明确了内部控制和风险管理责任,公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善,为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

(二)加强稽核监察,确保基金运作和公司经营合法合规

本报告期内,督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据,按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察,包括对基金投资交易行为、投资指标的监控,对投资组合的风险度量、评估和建议,对基金信息披露的审核、监督,对基金销售、营销的稽核、控制,对基金营运、技术系统的稽核、评估,切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

(三)强化培训教育,提高全员合规意识

本报告期内,督察长和稽核监察部门开展推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流,提升了员工的风险意识、合规意识,提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平,公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作,本报告期内,本基金管理人所管理的基金运作合法合规,充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,继续加强内部控制和风险管理,进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性,充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会,负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格,专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定:本基金根据每日基金收益情况,以基金净收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

本基金2014年1月1日至2014年12月31日期间累计分配收益7,087,147.23元,其中人民币5,560,180.76元以红利再投资方式结转入受收基金,人民币1,514,710.74元因基金赎回而可支付给投资者,其余人民币12,255.73元为期末应付收益。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全忠职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内),投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师汤骏、阎育化于2015年3月27日签字出具了安永华明(2015)审字第60466941_B37号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	22,357,812.92	123,755,016.79
结算备付金	445,000.00	494,761.90
存出保证金	-	-
交易性金融资产	24,001,755.43	69,650,899.27
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	24,001,755.43	69,650,899.27
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	23,000,127.50	7,100,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	661,869.89	1,710,122.79
应收股利	-	-
应收申购款	-	182,888.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	70,466,565.74	202,893,688.75
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	9,499,865.75
应付证券清算款	-	296,883.33
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	18,704.14	57,849.86
应付托管费	5,541.99	17,140.71
应付销售服务费	7,516.05	15,680.04
应付交易费用	6,579.80	1,801.91
应交税费	-	-
应付利息	-	6,719.85
应付利润	202,150.33	189,894.60
递延所得税负债	-	-
其他负债	159,000.00	179,000.00
负债合计	399,492.31	10,264,836.05
所有者权益:		
实收基金	70,067,073.43	192,628,852.70
未分配利润	-	-
所有者权益合计	70,067,073.43	192,628,852.70
负债和所有者权益总计	70,466,565.74	202,893,688.75

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额70,067,073.43份,其中,A级份额29,155,998.59份,B级份额40,911,074.84份。

7.2 利润表

会计主体:汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月24日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入	8,240,365.57	34,959,091.67
1.利息收入	7,458,541.67	34,650,226.17
其中:存款利息收入	4,973,285.28	26,604,383.91
债券利息收入	2,203,937.66	5,067,558.92
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	281,318.73	2,978,283.34
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	781,823.90	307,365.50
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	781,823.90	307,365.50
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	1,500.00
减:二、费用	1,153,218.34	5,397,882.52
1.管理人报酬	416,700.27	2,251,488.92
2.托管费	123,466.62	667,107.77
3.销售服务费	134,649.20	1,682,326.63
4.交易费用	198.27	-
5.利息支出	189,936.37	315,523.56
其中:卖出回购金融资产支出	189,936.37	315,523.56
6.其他费用	288,267.61	481,435.64
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	7,087,147.23	29,561,209.15

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	192,628,852.70	-	192,628,852.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,087,147.23	7,087,147.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-122,561,779.27	-	-122,561,779.27
其中:1.基金申购款	459,803,490.34	-	459,803,490.34
2.基金赎回款	-582,365,269.61	-	-582,365,269.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-7,087,147.23	-7,087,147.23
五、期末所有者权益(基金净值)	70,067,073.43	-	70,067,073.43

项目	上年度可比期间 2013年1月24日(基金合同生效日)至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	5,364,940,631.12	-	5,364,940,631.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	29,561,209.15	29,561,209.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-5,172,311,778.42	-	-5,172,311,778.42
其中:1.基金申购款	2,324,221,329.87	-	2,324,221,329.87
2.基金赎回款	-7,496,533,108.29	-	-7,496,533,108.29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-29,561,209.15	-29,561,209.15
五、期末所有者权益(基金净值)	192,268,852.70	-	192,268,852.70

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

林利军_____ 陈灿辉_____ 王小练_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]1587号文《关于核准汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人汇添富基金管理有限公司(现汇添富基金管理股份有限公司)向社会公开发行募集,基金合同于2013年1月24日正式生效,首次设立募集规模为5,364,940,631.12份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金主要投资于现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、期限在一年以内(含一年)的债券回购、中期票据、资产支持证券、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券,及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金的投资目标为追求本金安全、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。本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

7.4.2 会计投表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第5号《货币市场基金信