汇添富逆向投资股票型证券投资基金

【2015】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:2015年4月21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2015年4月17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	汇添富逆向投资股票
交易代码	470098
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月9日
报告期末基金份额总额	1,139,280,397.33份
投资目标	本基金主要采用逆向投资策略进行主动投资管理,在科学严格的投资风险管理前提下,谋求基金资产长期稳健回报。
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未被市场主流认同的价值被低估的股票以努力获取超额收益。
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	中国农业银行股份有限公司

§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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	74,114,530.53
2.本期利润	395,038,507.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.5883
4.期末基金资产净值	2,420,120,257.42
5.期末基金份额净值	2.124

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	31.19%	1.36%	11.94%	1.46%	19.25%	-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(2012年3月9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		
顾耀强	汇添富策略回报股票基金、汇添富逆向投资股票基金、汇添富均衡增长股票基金的基金经理。	2012年3月9日	-	11年	国籍:中国。学历:清华大学管理学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任杭州永磁集团公司技术员,海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、中海优质成长基金经理助理、中海能源策略基金经理助理。2009年3月加入汇添富基金管理股份有限公司任高级行业分析师,2009年7月7日至2011年3月13日任汇添富均衡增长股票基金的基金经理助理,2009年12月22日至今任汇添富策略回报股票基金的基金经理,2012年3月9日至今任汇添富逆向投资股票基金的基金经理,2014年4月8日至今任汇添富均衡增长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。本基金无违大违法、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

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,未发生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

一季度股市延续上涨态势,沪深300指数上涨14.64%,创业板更是气势如虹,单季大涨58.67%。互联网及互联网+引领市场,环保新能源等亦在政策和事件催化下表现强劲。去年底表现优异的金融等权重板块则回吐了部分涨幅。

一季度本基金继续坚持逆向投资策略,在上涨中逐步降低了部分互联网相关配置的权重,同时持续在一些景气处于底部的行业与公司中寻找可望出现拐点的投资标的进行布局(一季度收益率虽然跑赢了沪深300指数,但也错失了很多投资机会。本基金管理人将继续努力应对市场环境变化的挑战,不断完善投资体系和提升投资效率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2015年3月31日,本基金累计单位净值2.27元,一季度净值增长31.19%,成立以来累计收益率为127.40%。

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,本基金延续之前对市场偏积极的态度。几个重要的支撑力量尚未发生变化:实体经济疲软背景下进一步放松流动性的预期;财富效应推动的资金持续流入股市;国家一方面致力于推动创新与转型,一方面通过一带一路、区域规划等托底经济;特别是众多上市公司在新技术颠覆和传统模式难以为继的内外夹击下积极通过并购重组等方式寻求转型,造就了很多投资机会。二季度的关注点在于经历了前期快速巨大的上涨之后,市场是进一步结构性分化还是会出现阶段性的风格轮换。

从投资主题角度来看,一季度互联网及互联网+相关公司涨幅惊人,但仍是全年不容忽视的重要主题。其次,医药医疗、大消费等领域中的能够保持稳健增长的优秀公司,在经历了很长时间的低迷之后,当前也已经具备较强吸引力。此外,随着油价底部企稳,资源相关的资产在供求关系改善背景下逐步酝酿左侧布局的机会。

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	权益投资	2,061,056,265.28	78.32
	其中:股票	2,061,056,265.28	78.32
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	-	-
	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	212,100,404.20	8.06
7	其他资产	358,591,866.27	13.63
8	合计	2,631,748,535.75	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	271,547,854.88	11.22
C	制造业	848,104,567.13	35.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	275,303,778.11	11.38
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	228,582,600.69	9.45
J	金融业	321,639,252.03	13.29
K	房地产业	60,350,000.00	2.49
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	55,528,212.44	2.29
S	综合	-	-
	合计	2,061,056,265.28	85.16

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	601166	兴业银行	7,000,000	128,520,000.00	5.31
2	601318	中国平安	1,569,909	122,829,680.16	5.08
3	000906	物产中拓	5,739,800	115,140,388.00	4.76
4	300228	富瑞特装	1,599,795	107,986,162.50	4.46
5	002589	瑞康医药	1,899,293	105,980,549.40	4.38
6	600305	恒顺醋业	3,880,000	99,289,200.00	4.10
7	002236	大华股份	2,599,903	95,026,454.65	3.93
8	300006	莱美药业	2,299,919	93,491,707.35	3.86
9	601699	潞安环能	7,609,852	93,220,687.00	3.85
10	300380	安硕信息	500,000	82,500,000.00	3.41

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。

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。

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

注: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

注: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

注: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	553,197.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,955.65
5	应收申购款	358,005,713.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	358,591,866.27

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	354,072,692.71
报告期期间基金总申购份额	1,651,302,694.90
减:报告期期间基金总赎回份额	866,094,990.28
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	1,139,280,397.33

注:表内"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 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,自2015年4月3日起,本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。详情请见2015年4月4日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富逆向投资股票型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富逆向投资股票型证券投资基金合同》;
3、《汇添富逆向投资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、报告期内汇添富逆向投资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。

9.2 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

9.3 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4月21日

汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金

【2015】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:2015年4月21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4月17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	汇添富年年利定期开放债券	
交易代码	000221	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年9月6日	
报告期末基金份额总额	213,012,999.01份	
投资目标	在追求本金安全的基础上,本基金力争创造超越业绩比较基准的长期稳健收益。	
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%,在每个受限开放期的前10个工作日和后10个工作日、自由开放期的前3个月和后3个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制,但在开放期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	银行一年期定期存款税后利率+1.2%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	汇添富年年利定期开放债券A	汇添富年年利定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	000221	000222
报告期末下属分级基金的份额总额	127,164,520.24份	85,848,478.77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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)	
	汇添富年年利定期开放债券A	汇添富年年利定期开放债券C
1.本期已实现收益	2,833,247.70	1,903,972.58
2.本期利润	4,288,436.04	3,013,491.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0283	0.0277
4.期末基金资产净值	142,148,805.20	95,438,633.82
5.期末基金份额净值	1.118	1.112

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

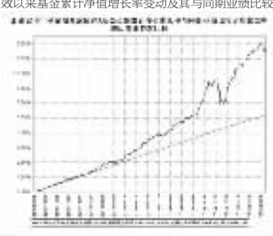
汇添富年年利定期开放债券A

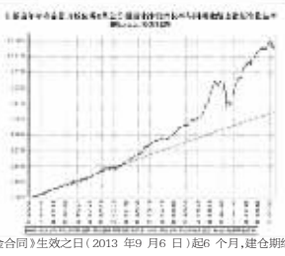
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.47%	0.12%	0.95%	0.01%	1.52%	0.11%

汇添富年年利定期开放债券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	2.39%	0.12%	0.95%	0.01%	1.44%	0.11%

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(2013年9月6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		
陈加荣	汇添富理财14天债券基金的基金经理助理,汇添富双利债券基金、汇添富信用债券基金、汇添富高息债券基金、汇添富年年利定期开放债券基金的基金经理。	2013年9月6日	-	14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日任汇添富收益快钱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、汇添富信用债券基金的基金经理,2013年6月27日至今任汇添富高息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

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,未发生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

1季度前两个月,由于经济仍然趋弱,降准、降息预期较强烈,一股债券收益率再次下行,10年国开债4.07%下降到2月底的3.67%,5年AA+城投债5.62%下降到2月底的4.97%,3月份在央行再次降息后,由于市场对再次降息的预期大幅减弱,而对经济可能逐步筑底的预期增强,尤其对财政部地方债置换可能引发类利率债供给大幅上升的预期,一般债券收益率开始上行,降息操作形成了加息的效果,10年国开债收益率债月份上升到4.16%,5年AA+城投债收益率反弹到5.52%。权益类市场1季度则充满了对改革所带来的美好前景的憧憬,尽管经济仍然较弱,1季度下半期原来推动市场上涨的无风险利率甚至有所上行,创业板指数大涨59.93%,上证综指振荡上行15.87%。转债在这场狂欢中由于估值压制,以及行业分布的原因,市场热度远不及去年4季度,中证转债指数小幅上涨2.45%。

本基金1季度对基金组合做了适当调整,在有限开放日前大幅减持短久期信用债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年1季度本基金A级净值收益率为2.47%,C级净值收益率为2.39%,同期业绩比较基准收益率为0.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2季度经济处于筑底过程中,可能略有好转,通胀不足虑,央行仍可能继续通过创新或传统的手段放松。在目前债券收益率已较2月底较大幅的上升的情况下,债券投资仍然具有一定的保护边际,但波动较去年将明显增大。可转债尽管性价比下降,但仍具价值,需要积极参与新转债的申购。

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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	393,002,935.86	89.81
	其中:债券	388,002,935.86	88.67
	资产支持证券	5,000,000.00	1.14
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	33,051,832.12	7.55
7	其他资产	11,546,927.01	2.64
8	合计	437,601,694.99	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	54,118,800.00	22.78
	其中:政策性金融债	54,118,800.00	22.78
4	企业债券	242,260,530.86	101.97
5	企业短期融资券	90,606,000.00	38.14
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,017,605.00	0.43
8	其他	-	-
9	合计	388,002,935.86	163.31

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	140216	14国开16	300,000	30,129,000.00	12.68
2	140222	14国开22	200,000	20,870,000.00	8.78
3	122276	13魏桥01	196,150	20,546,712.50	8.65
4	122337	13魏桥02	202,000	20,296,960.00	8.54
5	041456038	14龙岩工贸CP001	200,000	20,156,000.00	8.48

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119109	14祈盛01	50,000	5,000,000.00	2.10

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

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

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	10,593.15
2	应收证券清算款	1,996,778.32
3	应收股利	-
4	应收利息	9,539,555.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,546,927.01

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处于转股期的可转换债券。

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	汇添富年年利定期开放债券A	汇添富年年利定期开放债券C
报告期期初基金份额总额	154,598,430.33	111,667,817.59
报告期期间基金总申购份额	154,701.45	227,191.39
减:报告期期间基金总赎回份额	27,588,611.54	26,046,530.21
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	127,164,520.24	85,848,478.77

§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 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,自2015年4月3日起,本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。详情请见2015年4月4日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金合同》;
3、《汇添富年年利定期开放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、报告期内汇添富年年利定期开放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。

9.2 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

9.3 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4月21日

汇添富收益快钱货币市场基金

【2015】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:2015年4月21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4月17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	汇添富快钱货币
场内简称	添富快钱
交易代码	159005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月23日
报告期末基金份额总额	3,915,203.00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
下属分级基金的基金简称	添富快钱A	添富快钱B
下属分级基金的交易代码	159005	159006
报告期末下属分级基金的份额总额	2,575,967.00份	1,339,236.00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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)	
	添富快钱A	添富快钱B
1. 本期已实现收益	1,582,998.60	2,880,164.62
2.本期利润	1,582,998.60	2,880,164.62
3.期末基金资产净值	257,596,700.00	133,923,600.00

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

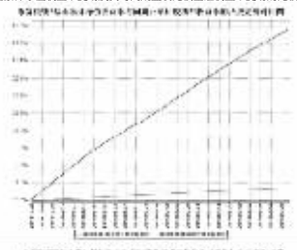
添富快钱A

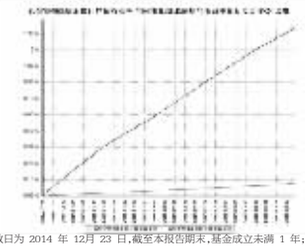
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1238%	0.0016%	0.0863%	0.0000%	1.0375%	0.0016%

添富快钱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	1.1837%	0.0017%	0.0863%	0.0000%	1.0974%	0.0017%

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 2014 年 12月 23 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(2014年12月23日)起6个月,截止本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

§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		
陆文磊	汇添富增强收益债券基金、汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富互利分级债券基金、汇添富金额宝货币基金、汇添富收益快钱货币基金、汇添富收益快钱货币基金的基金经理,固定收益投资总监。	2014年12月23日	-	13年	国籍:中国。学历:华东师范大学金融学博士。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任固定收益高级经理,现任固定收