汇添富和聚宝货币市场基金

【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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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	汇添富和聚宝货币
交易代码	000600
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月28日
报告期末基金份额总额	2,060,351,726.77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	上海浦东发展银行股份有限公司

§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

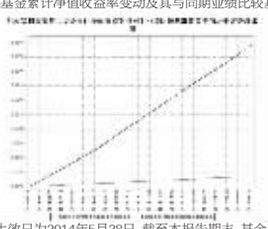
主要财务指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1. 本期已实现收益	20,417,770.85
2.本期利润	20,417,770.85
3.期末基金资产净值	2,060,351,726.77

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	1.1828%	0.0013%	0.0863%	0.0000%	1.0965%	0.0013%

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5月28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5月28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		
汤从珊	汇添富货币基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金、汇添富和聚宝货币基金、汇添富添富通货币基金的基金经理。	2014年5月28日	-	7年	国籍:中国,学历:上海财经大学管理学硕士。相关业务资格:基金从业资格。从业经历:2008年5月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任固定收益交易员、固定收益交易主管。2013年7月31日至今任汇添富货币基金的基金经理,2013年12月13日至今任汇添富全额宝货币基金的基金经理。2014年1月21日至今任汇添富理财30天债券、理财60天债券基金的基金经理。2014年5月28日至今任汇添富和聚宝货币基金的基金经理。2015年1月16日至今任汇添富添富通货币基金(原汇添富新收益债券基金)的基金经理。
徐寅喆	汇添富和聚宝货币基金、汇添富收益快钱货币基金、汇添富收益快钱货币基金、汇添富理财7天债券基金的基金经理。	2014年11月26日	-	7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 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。

4.3.2 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

2015年一季度GDP增长7%;工业增加值6.4%,较14年全年8.3%出现大滑坡,工业增加值的明显下降表明一季度实体企业的经营情况不佳,仍然需要有针对性的扶持政策;一季度央行货币政策保持了的宽松的总基调,具体操作上尺度可能还要大一些,即便如此,一季度投资、消费、进出口数据全面走低,整体而言,一季度GDP勉强达标,但分项数据的疲弱,预示着二季度不宜太乐观。

一季度债券市场以宽幅震荡为主,利率债收益率的绝对水平不高,在全社会风险偏好提高的情况下,配置盘和交易盘都难有大的动力;作为去年一系列信用收缩政策的滞后影响,信用风险事件明显增多,三月份财政部推出的一万亿债券置换,对债市形成一定的冲击;总体而言,尽管有大量的新股发行,但市场资金充沛,一季度回购利率不高。

受益于良好的政策预期和引导,股市出现强劲上涨,尤其是两会尾声,李克强总理和周小川行长的表述更加坚定了市场做多的信心,"互联网+"也提供了非常好的投资方向;一季度创业板指数大涨59%,主板的涨幅仅在15%左右。可转债一月中旬出现了大级别的调整,后续受制于过高的估值和题材的缺乏,表现不佳,一季度中标可转债指数反而下跌0.28%。

本组合一季度有较大的中购,信用债比例逐步下降,通过中等久期的优质城投债和一年内的短融,可转债在1月份略回吐浮盈后大幅减仓,此后一直保持极低的仓位。考虑到股市的牛市基调已经明确,本组合一季度股票配置比例一直在15%之上,个股相对分散,收到了良好的效果。

本基金本期内净值上涨5.87%,股票的贡献占比最高,本期内我们平稳地应对了规模的变动,股票高仓位而可转债低仓位,组合业绩提高较多。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

一季度,本基金A级净值增长率为5.87%,比同期业绩比较基准收益率高4.54个百分点;本基金C级净值增长率为5.66%,比同期业绩比较基准收益率高4.33个百分点。

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	574,997,955.35	27.02
	其中:债券	574,997,955.35	27.02
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	99,000,508.50	4.65
	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	1,437,139,103.48	67.53
4	其他资产	17,044,754.80	0.80
5	合计	2,128,182,322.13	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		2.85
	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	66,994,566.50	3.25
	其中:买断式回购融资	-	-

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	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	99
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

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	32.33	3.25
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	23.78	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	17.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	6.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	22.81	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		102.46	3.25

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	109,987,590.98	5.34
	其中:政策性金融债	109,987,590.98	5.34
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	465,010,364.37	22.57
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	574,997,955.35	27.91
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	140437	14农发37	400,000	40,011,768.31	1.94
2	041460079	14梅花CP002	350,000	35,024,722.54	1.70
3	041551007	15海亮CP001	300,000	30,029,209.98	1.46
4	140429	14农发29	300,000	30,002,263.61	1.46
5	041461046	14渝外贸CP001	200,000	20,085,551.99	0.97
6	041466026	14洪涛CP001	200,000	20,061,376.62	0.97
7	041464067	14皖高速CP002	200,000	20,024,560.17	0.97
8	041458095	14均瑶CP002	200,000	20,001,859.22	0.97
9	011594001	15风传媒SCP001	200,000	19,997,632.33	0.97
10	011595001	15中化工SCP001	200,000	19,994,927.46	0.97

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	0.0599%
报告期内偏离度的最低值	-0.0375%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0353%

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

本报告期内货币市场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、处罚的情况。

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	17,033,754.80
4	应收申购款	-
5	其他应收款	11,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	17,044,754.80

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,515,987,779.80
报告期期间基金总申购份额	2,081,244,625.54
减:报告期期间基金总赎回份额	1,536,880,678.57
报告期末基金份额总额	2,060,351,726.77

注:总申购份额含红利再投份额。

§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 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和聚宝货币市场基金募集的文件;

2、《汇添富和聚宝货币市场基金基金合同》;

3、《汇添富和聚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、报告期内汇添富和聚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。

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

汇添富高息债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	97,436,287.78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
下属分级基金的基金简称	汇添富高息债A / 汇添富高息债C
下属分级基金的交易代码	000174 / 000175
报告期末下属分级基金的份额总额	55,309,704.27份 / 42,126,583.51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)	
	汇添富高息债A	汇添富高息债C
1.本期已实现收益	3,867,351.74	3,507,902.52
2.本期利润	2,282,043.28	2,083,506.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0386	0.0382
4.期末基金资产净值	72,292,448.85	54,626,970.64
5.期末基金份额净值	1.307	1.297

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

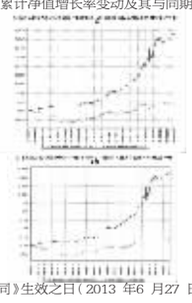
汇添富高息债A

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	3.48%	0.43%	-0.15%	0.09%	3.63%	0.34%

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	3.43%	0.43%	-0.15%	0.09%	3.58%	0.34%

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	-	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,2013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