汇添富理财14天债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月18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7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富理财14天债券	
交易代码	470014	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年7月10日	
报告期末基金份额总额	48,859,280.44份	
投资目标	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限控制在134天以内,在控制利率风险、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,长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。	
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	汇添富理财14天债券A	汇添富理财14天债券B
下属分级基金的交易代码	470014	471014
报告期末下属分级基金的份额总额	48,859,280.44份	- 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4月1日 - 2015年6月30日)	
	汇添富理财14天债券A	汇添富理财14天债券B
1. 本期已实现收益	432,780.65	44,728.99
2. 本期利润	432,780.65	44,728.99
3. 期末基金资产净值	48,859,280.44	-

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

汇添富理财14天债券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	0.6993%	0.0109%	0.3366%	0.0000%	0.3627%	0.0109%

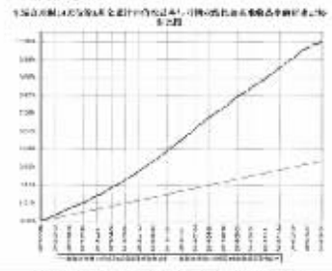
注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。
2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

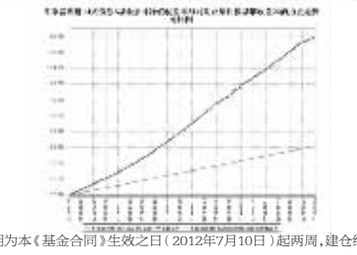
汇添富理财14天债券B

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	0.7443%	0.0109%	0.3366%	0.0000%	0.4077%	0.0109%

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。

3.2.2 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(2012年7月10日)起两周,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		
蒋文玲	汇添富现金宝、理财14天、理财21天基金的基金经理,汇添富多元收益债券、实业债债券基金的基金经理助理。	2015年3月10日	-	9年	国籍:中国。学历:上海财经大学经济学硕士。业务资格: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、债券风控研究员。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,历任金融工程部高级经理、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28天债券基金的基金经理助理;2014年4月8日至今任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,2015年3月10日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富理财21天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,是由于投资流动性的需求导致。

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

二季度债券市场收益率波动仍呈“V”型走势。在央行连续采用降准、降息和SLF等多种放松方式后,4月中旬资金面转为宽松,7天回购利率从一季末约4%的水平一路下行至最低2%,货币市场和债券市场也相应下行,其中1年期AAA短融收益率降幅高达近200BP,10年期金融债收益率最高降幅40BP,6月份受新股发行和季末因素叠加的影响,收益率有所反弹。

与上季末相比,本基金规模继续缩水,受制于规模较小的影响,组合收益率难以明显提高。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,组合持仓以AA-AA+等中高等级品种为主,提高了组合的流动性和安全性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A级净值增长率为0.6993%,B级净值增长率为0.7443%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来国际环境扑朔迷离,美国加息预期升温,美元中期走强,而希腊面临退欧的不确定性,加剧了欧元区的动荡,推升全球避险情绪。国内经济方面,最近几个月M2和社融余额增速创历史新低,货币增速仍延续环比回落的态势,其背后对应的是投资和融资需求的持续萎缩。上半年房地产市场有所回暖,但是全国范围看二、三线以下城市的去库存压力极大,预计年内房地产投资对经济增长的贡献较小,总体来看三季度经济在去杠杆的大周期下仍有较大的下行风险,货币政策的放松有必要保持连贯性。预计三季度债市仍有较好的表现,考虑到整体收益率已经处于低位,债市波动性大的特征仍会贯穿始终。此外,实体经济较差导致的企业违约风险会显著增大,这一点值得警惕。

由于本基金规模持续保持在1个亿以下,组合流动性管理难度有所增强,我们将持续跟踪每一个运作周期的特点,分析本基金的份额变动规律,提前做好债券与存款之间的配置计划,合理搭配回购、同业存款、短融、金融债等品种,力争在注重流动性的同时提高组合收益,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 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	固定收益投资	19,984,668.34	40.65
	其中:债券	19,984,668.34	40.65
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	6,000,000.00	12.20
	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	20,415,729.56	41.53
4	其他资产	2,763,098.25	5.62
5	合计	49,163,496.15	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	4.09
	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	-	-
	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。

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	54
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	59
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	10

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134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	54.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	30.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	10.19	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		94.97	-

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	10,005,561.20	20.48
	其中:政策性金融债	10,005,561.20	20.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	9,979,107.14	20.42
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	19,984,668.34	40.90
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	140443	14农发43	100,000	10,005,561.20	20.48
2	071547001	15国联证券CP001	50,000	4,999,478.17	10.23
3	041551007	15海亮CP001	50,000	4,979,628.97	10.19

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	8
报告期内偏离度的最高值	0.3023%
报告期内偏离度的最低值	0.0226%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1732%

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	480,198.25
4	应收申购款	2,282,900.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,763,098.25

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富理财14天债券A	汇添富理财14天债券B
报告期期初基金份额总额	67,765,381.59	5,042,008.92
报告期期间基金总申购份额	53,561,671.17	14,030,963.04
减:报告期期间基金总赎回份额	72,467,772.32	19,072,971.96
报告期期末基金份额总额	48,859,280.44	-

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

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内基金管理人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理财14天债券型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富理财14天债券型证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富理财14天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、报告期内汇添富理财14天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
2015年7月18日

汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月18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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富理财21天债券发起式	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	70,700,816.12份	
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。	
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	
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	28,840,722.39份	41,860,093.73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4月1日 - 2015年6月30日)	
	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
1. 本期已实现收益	216,011.26	411,631.54
2. 本期利润	216,011.26	411,631.54
3. 期末基金资产净值	28,840,722.39	41,860,093.73

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

汇添富理财21天债券发起式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	0.9198%	0.0189%	0.3366%	0.0000%	0.5832%	0.0189%

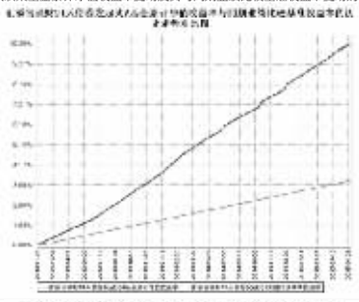
注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。
2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

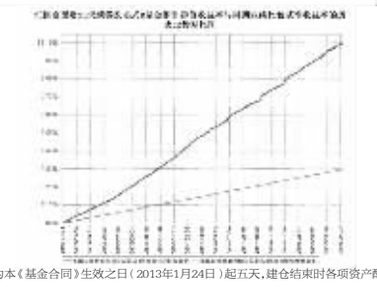
汇添富理财21天债券发起式B

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	0.9927%	0.0189%	0.3366%	0.0000%	0.6561%	0.0189%

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。

3.2.2 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1月24日)起五天,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		
蒋文玲	汇添富现金宝、理财14天、理财21天基金的基金经理,汇添富多元收益债券、实业债债券基金的基金经理助理。	2015年3月10日	-	9年	国籍:中国。学历:上海财经大学经济学硕士。业务资格: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、债券风控研究员。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,历任金融工程部高级经理、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28天债券基金的基金经理助理;2014年4月8日至今任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,2015年3月10日至今任汇添富现金宝货币基金、汇添富理财14天债券基金、汇添富理财21天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,是由于投资流动性的需求导致。

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

二季度债券市场收益率波动仍呈“V”型走势。在央行连续采用降准、降息和SLF等多种放松方式后,4月中旬资金面转为宽松,7天回购利率从一季末约4%的水平一路下行至最低2%,货币市场和债券市场也相应下行,其中1年期AAA短融收益率降幅高达近200BP,10年期金融债收益率最高降幅40BP,6月份受新股发行和季末因素叠加的影响,收益率有所反弹。

与上季末相比,本基金规模相对较大,持续处于1亿元以下的低位,受制于规模较小的影响,组合收益率难以明显提高。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,组合持仓以AA-AA+等中高等级品种为主,提高了组合的流动性和安全性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

二季度本基金A级净值收益率为0.9198%,B级净值收益率为0.9927%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来国际环境扑朔迷离,美国加息预期升温,美元中期走强,而希腊面临退欧的不确定性,加剧了欧元区的动荡,推升全球避险情绪。国内经济方面,最近几个月M2和社融余额增速创历史新低,货币增速仍延续环比回落的态势,其背后对应的是投资和融资需求的持续萎缩。上半年房地产市场有所回暖,但是全国范围看二、三线以下城市的去库存压力极大,预计年内房地产投资对经济增长的贡献较小,总体来看三季度经济在去杠杆的大周期下仍有较大的下行风险,货币政策的放松有必要保持连贯性。预计三季度债市仍有较好的表现,考虑到整体收益率已经处于低位,债市波动性大的特征仍会贯穿始终。

由于本基金规模持续保持在1个亿以下,组合流动性管理难度有所增强,我们将持续跟踪每一个运作周期的特点,分析本基金的份额变动规律,提前做好债券与存款之间的配置计划,合理搭配回购、同业存款、短融、金融债等品种,力争在注重流动性的同时提高组合收益,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 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	固定收益投资	30,076,331.43	42.43
	其中:债券	30,076,331.43	42.43
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	36,004,177.54	50.79
4	其他资产	4,804,776.93	6.78
5	合计	70,885,285.90	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	0.08
	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	-	-
	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。

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	56
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	92
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

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141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	42.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	35.37	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	7.12	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	7.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	7.12	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.12	-

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	10,004,961.56	14.15
	其中:政策性金融债	10,004,961.56	14.15
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,071,369.87	28.39
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	30,076,331.43	42.54
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	140443	14农发43	100,000	10,004,961.56	14.15
2	041462040	14富通CP002	50,000	5,037,266.93	7.12
3	041551007	15海亮CP001	50,000	5,035,322.50	7.12
4	071547001	15国联证券CP001	50,000	4,999,478.17	7.07
5	041458079	14鞍山城建CP001	50,000	4,999,302.27	7.07

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	20
报告期内偏离度的最高值	0.3214%
报告期内偏离度的最低值	0.0639%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2023%

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	4,002,107.78
3	应收利息	797,669.15
4	应收申购款	5,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,804,776.93

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	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
报告期期初基金份额总额	27,494,975.16	41,393,881.17
报告期期间基金总申购份额	18,599,578.34	466,212.56
减:报告期期间基金总赎回份额	17,253,831.11	-
报告期期末基金份额总额	28,840,722.39	41,860,093.73

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:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金情况

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	11,101,633.27	15.70	10,000,000.00	14.14	认购的基金份额持有期限不低于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,101,633.27	15.70	10,000,000.00	14.14	认购的基金份额持有期限不低于三年

§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理财21天债券型发起式证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富理财21天债券型发起式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、报告期内汇添富理财21天债券型发起式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7月18日

汇添富理财30天债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月18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7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富理财30天债券	
交易代码	470030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年5月9日	
报告期末基金份额总额	783,644,266.94份	
投资目标	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	将采用积极管理型的投资策略,原则上将投资组合的平均剩余期限控制在150天以内,在控制利率风险、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	本基金管理人将经营管理中的主要风险划分为投资风险、合规风险、营运风险和道德风险四大类,其中,投资风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险等。针对上述各类风险,基金管理人建立了一套完整的风险管理体系	
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	汇添富理财30天债券A	汇添富理财30天债券B
下属分级基金的交易代码	470030	471030
报告期末下属分级基金的份额总额	767,466,949.18份	16,177,317.76份

§3 主要财务指标和