汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金

【2015】第三季度报告

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10月27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10月23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7月1日起至9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	90,848,061.79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	48,775,755.10份	42,072,306.69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7月1日 - 2015年9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	109,796.75	267,521.00
2. 本期利润	109,796.75	267,521.00
3. 期末基金资产净值	48,775,755.10	42,072,306.69

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	0.5657%	0.0111%	0.3403%	0.0000%	0.2254%	0.0111%

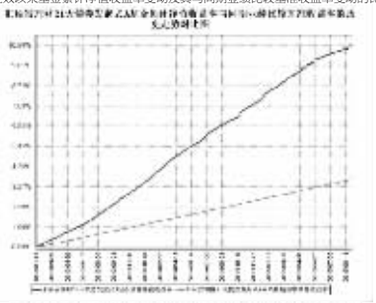
注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。
2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

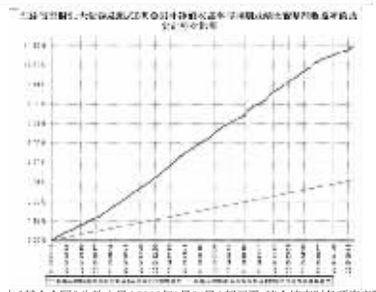
汇添富理财21天债券发起式B

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	0.6388%	0.0111%	0.3403%	0.0000%	0.2985%	0.0111%

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,是由于合规控制原因调整导致。经检查和分析未发现异常情况。

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

本季度,债市顺利打破"三季度魔咒",继续演绎牛市行情。受益于股市暴跌、IPO暂停,以及货币政策持续放松,资金宽松程度较前两个季度明显改善,加上机构对债券需求强劲,债券收益率再下台阶,其中10年金融债至9月底已经突破3.7%,较2季末下行40BP,信用债交投活跃,收益率降幅与金融债基本一致,但是一年期债券相对弱势,收益率窄幅波动,收益率曲线平坦化显著,表现出"牛平"特征。

与上季度相比,本基金在三季度规模有所增加,但仍然处于1个亿以下的低位。受组合规模过低、定存和现券收益下降的影响,组合收益率逐步走低。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

三季度本基金A级净值收益率为0.5657%,B级净值收益率为0.6388%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

8月份全球金融市场剧烈动荡,美联储也因此决定延缓加息时点,没有选择9月份加息。但是在全球步入经济衰退的寒流中,唯独美国基本面稳健复苏,劳动力继续改善,预计年内加息仍是大概率事件,美元中期走强,加上大宗商品疲软,对新兴市场的打击可谓雪上加霜,也使我国进出口贸易受到较大冲击;投资方面,固定投资继续下滑,基建投资难以独挑大梁,房地产行业去库存压力仍大,房地产销量较之前两个季度已经开始回落,一线市场土地出让持续低迷,新开工难有显著回升,预计年内房地产投资对经济增长的贡献较小,四季度经济环比负增长可能性较大,货币政策的放松有必要保持连贯性。预计四季度债市仍有下行的空间,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,经济下行过程中,企业违约风险会显著攀大,0%二重债的实质性违约也给我们敲响了警钟。

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	25,040,425.61	27.47
	其中:债券	25,040,425.61	27.47
	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	65,554,726.70	71.92
4	其他资产	555,399.21	0.61
5	合计	91,150,551.52	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	3.53	
	其中:买断式回购融资	3.53	
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	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

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	72.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	11.03	-
	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	5.53	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	11.00	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.72	-

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	9,995,197.00	11.00
	其中:政策性金融债	9,995,197.00	11.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	15,045,228.61	16.56
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	25,040,425.61	27.56
10	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	150413	15农发13	100,000	9,995,197.00	11.00
2	041551007	15海兴CP001	50,000	5,022,879.27	5.53
3	011599040	15南方水泥SCP002	50,000	5,022,464.62	5.53
4	041458079	14胶山城建CP001	50,000	4,999,884.72	5.50

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	15
报告期内偏离度的最高值	0.2832%
报告期内偏离度的最低值	0.1162%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2169%

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	555,399.21
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	555,399.21

§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	28,840,722.39	41,860,093.73
报告期期间基金总申购份额	36,763,965.16	212,212.96
减:报告期期间基金总赎回份额	16,828,932.45	0.00
报告期期末基金份额总额	48,775,755.10	42,072,306.69

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 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	11,157,335.26	12.28	10,000,000.00	11.01	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	11,157,335.26	12.28	10,000,000.00	11.01	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10月27日

汇添富理财30天债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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10月27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10月23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7月1日起至9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	657,666,960.69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整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	626,346,404.91份	31,320,555.78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7月1日 - 2015年9月30日)	
	汇添富理财30天债券A	汇添富理财30天债券B
1. 本期已实现收益	5,637,519.53	217,759.50
2. 本期利润	5,637,519.53	217,759.50
3. 期末基金资产净值	626,346,404.91	31,320,555.78

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30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	0.8170%	0.0068%	0.3403%	0.0000%	0.4767%	0.0068%

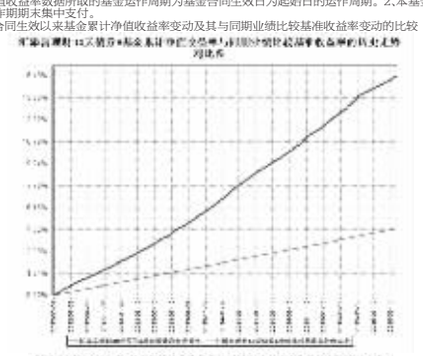
注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

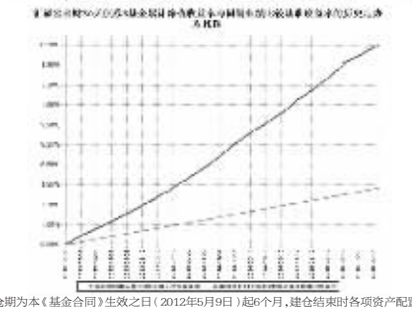
汇添富理财30天债券B

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	0.8907%	0.0068%	0.3403%	0.0000%	0.5504%	0.0068%

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5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		
汤从珊	汇添富货币基金、汇添富现金宝货币基金、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、汇添富添益通货币基金的基金经理。	2014年1月21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2015年7月30日任汇添富和聚宝货币基金的基金经理。2015年1月16日至今任汇添富添益通货币基金(原汇添富新收益债券基金)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,是由于合规控制原因调整导致。经检查和分析未发现异常情况。

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 三季度经济下行压力仍然较大,央行维持较为宽松的货币政策,资金利率低位运行。7月以来,由于半年末效应消除,打新暂停,部分打新资金暂时重回债市,市场资金面步入宽松,同时股市表现差强人意使得投资者风险偏好降低,膨挪出部分仓位配置短期信用债,短融收益率和存款利率快速下行,信用利差迅速压缩。8月,由于11日央行调整人民币中间价形成机制,导致人民币汇率出现大幅贬值,资金流出压力较大,资金成本在中旬以后逐步走高,且存款利率和短融收益率也在到达低位后开始反弹,出现利率的小高点。9月以来,由于降准的效用体现,央行对较为宽松的货币环境的呵护,资金面较8月底逐步回暖,但季末等因素使得9月下旬也出现了不错的投资机会。

本基金在报告期安排了较大比例的流动性于月末、季末等可能发生流动性紧张的时点滚动操作,在短融收益率高企的时点战略性建仓,并持续改善组合持仓中短融的流动性。通过短融的波段性操作和合理错配存款到期日,在保证组合整体流动性的前提下,抓住资金利率高企的时间窗口锁定高息存款和优质短融提高组合收益率。通过这些前瞻性的操作,本基金有效应对了组合的规模变化,确保了组合的流动性和和合法合规运作,并抓住关键时点锁定了一部分较高收益的同业存款和短期债券获取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

三季度本基金A级净值收益率为0.8170%,B级净值收益率为0.8907%。

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年四季度,国内经济下行的压力仍然较大,内需弱势未改,外需改善有限,需要政策继续宽松护航,同时美国经济复苏不及预期,市场预期美国加息节奏将放缓,同时人民币汇率近期趋于稳定,在政府的强势维稳下,继续贬值的概率不大,热钱流出的速度将显著放缓,资金利率稳定在较为宽松的水平,对债市整体有利,但需要紧密观察经济复苏的情况以判断货币政策放松的幅度和速度。

同时,由于货币市场可能面临IPO 重启、风险资产配置意愿增强、汇率贬值资金外流等事件的冲击,且下半年资金面相对上半年更为谨慎,如果市场情绪过于乐观,需要防范资金的超预期收紧带来的收益率波动。近期英利中票、雨润中票、中钢债等信用事件频发,刚兑打破的历史趋势未变且有加速之势,利于无风险利率的进一步下行。而当前信用利差保护不足,信用债投资需仔细排雷,配置以中高等级为主,严防信用风险。

有鉴于此,本基金将在密切跟踪基本面、政策面和资金面前提下,综合分析本基金的份额变动,提前做好债券与存款之间的配置计划,保持组合的较高流动性和安全性,积极把握市场结构性机会,通过在合适的时点锁定高收益的存款和灵活控制短融仓位博取资本利得收入为投资者创造更多额外收益。

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	365,247,027.91	55.39
	其中:债券	365,247,027.91	55.39
	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	286,497,435.28	43.45
4	其他资产	7,656,500.77	1.16
5	合计	659,400,963.96	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	3.11
	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	119
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	130
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	86

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150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	24.72	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	5.32	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	9.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	36.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.42	-
5	180天(含)-397天(含)	27.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		103.67	-

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	69,132,539.16	10.51
	其中:政策性金融债	69,132,539.16	10.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	276,450,236.66	42.03
6	中期票据	-	-
7	同业存单	19,664,252.09	2.99
8	其他	-	-
9	合计	365,247,027.91	55.54
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	29,038,536.89	4.42

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	120227	12国开27	300,000	29,038,536.89	4.42
2	041554020	15兵团投资CP001	200,000	20,266,941.01	3.08
3	041559006	15亨通CP001	200,000	20,187,530.91	3.07
4	041559028	15桐乡城建CP001	200,000	20,114,202.26	3.06
5	041564016	15滨建工CP001	200,000	20,113,161.08	3.06
6	041562021	15金港CP001	200,000	20,046,808.83	3.05
7	041451060	14大装备CP001	200,000	20,025,668.54	3.04
8	111519052	15恒丰银行CD052	200,000	19,664,252.09	2.99
9	041562017	15亚邦CP002	100,000	10,089,694.06	1.53
10	041558056	15圣邦CP002	100,000	10,089,049.77	1.53

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	40
报告期内偏离度的最高值	0.3628%
报告期内偏离度的最低值	0.0684%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2760%

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	7,656,500.77
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	7,656,500.77

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富理财30天债券A	汇添富理财30天债券B
报告期期初基金份额总额	767,466,949.18	16,177,317.76
报告期期间基金总申购份额	150,985,200.40	25,143,238.02
减:报告期期间基金总赎回份额	292,105,744.67	10,000,000.00
报告期期末基金份额总额	626,346,404.91	31,320,555.78

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。

§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30天债券型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富理财30天债券型证券投资基金合同》;
3、《汇添富理财30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30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10月27日

汇添富理财60天债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告