汇添富实业债债券型证券投资基金

2015年9月30日

[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	汇添富实业债债券	
交易代码	000122	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年6月14日	
报告期末基金份额总额	521,065,621.45份	
投资目标	在严格管理风险和保持资产流动性的基础上,努力实现资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%;其中对实业债的投资比例不低于债券类资产的80%,实业债指以生产制造和基础设施为主业的企业所发行的债券,包括公司债、企业债(含城投债)、可转换债券、可分离债券、短期融资券(不含金融企业短期融资券)、中期票据和中小企业私募债券;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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富实业债债券A	汇添富实业债债券C
下属分级基金的交易代码	000122	000123
报告期末下属分级基金的份额总额	431,334,857.21份	89,730,764.24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)	
	汇添富实业债债券A	汇添富实业债债券C
1. 本期已实现收益	3,024,504.46	734,674.07
2. 本期利润	5,471,004.64	1,431,123.00
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0228	0.0217
4. 期末基金资产净值	507,880,410.62	104,430,015.03
5. 期末基金份额净值	1.177	1.164

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

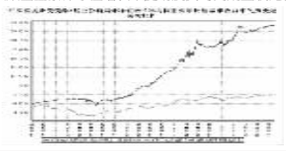
汇添富实业债债券A

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	1.82%	0.12%	1.12%	0.06%	0.70%	0.06%

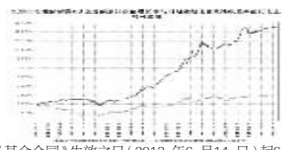
汇添富实业债债券C

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	1.84%	0.11%	1.12%	0.06%	0.72%	0.05%

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14日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。



§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		
曾刚	汇添富多元收益债券基金、可转换债券基金、实业债债券基金、双利增强债券基金的基金经理,固定收益投资副总监。	2013年6月14日	-	14年	国籍:中国。学历:中国科技大学学士,清华大学MBA。业务资格:基金从业资格。从业经历:曾在红塔证券、汉唐证券、华宝兴业基金负责宏观经济和债券的研究,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1日任华富收益增强基金的基金经理,2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报基金的基金经理。2011年11月加入汇添富基金,历任金融工程部高级经理、基金经理助理,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2015年3月31日任汇添富理财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29日至2015年3月31日任汇添富理财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至2015年3月31日任汇添富现金宝货币基金的基金经理,2013年12月3日至今任汇添富双利增强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均执行情况良好。

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年三季度宏观经济继续疲弱,实体企业盈利能力下降,PMI指数仍在小幅下滑,企业的困境没有得到改善,这叠加在一起,就出现了央行在货币上积极放松,但银行又慎贷、实体企业尤其是民企融资成本难以真正下降的现象。外贸数据堪忧,短期恐难以好转;投资方面,目前中央和部委相对积极,轨交、管网、环保等项目批复很快,难点在于落地的实效不高。三季度房地产相关政策放宽,房企内地公司债融资集中释放,对房屋成交量有所推动,但对房地产投资不能抱有过高期望。从月度数据上也只有很少的指标短期回暖,当前市场一致预期三季度GDP破7概率相当大。三季度内,股票市场清理配资,加上汇率的波动,美联储加息的风险,投资者的风险偏好再次骤降,股市跌幅较大。但在打新混合、融资融券等8%以上高收益的类固收资产消退之后,全社会的无风险利率确定性地下了一个台阶,债市因此受益出现持续上涨,大类资产配置上出现了方向性的转折。

三季度央行政策应对上不遗余力,主动降准降息,资金利率处于低位,债市收益率下降明显,其中长端利率债上半年蛰伏,三季度大有收获,在接连出现信用风险事件的情况下,信用利差持续处于历史均值的绝对底部区域。本季度中债总财富指数上涨2.13%

三季度股票市场连续下跌,各大指数跌幅都在28%上下,上半年的牛市逻辑支柱成为这一波下跌的备注,杠杆、资金和改革都面临不同的尴尬,对投资者的冲击过大,市场人气消散。中证转债指数下跌20.7%,估值水平仍不算便宜,配置价值有限。本组合三季度规模增长较快,净值上涨1.8%,期间积极增加了交易所可质押公司债的配置,增加短融、中票等短期流动性品种,少量参与了可转债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年三季度本基金A级净值收益率为1.82%,C级净值收益率为1.84%,同期业绩比较基准收益率为1.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济数据欠佳,这已成共识,短期内边际影响不大,而经济弱势和央行宽松在中长期对债市形成支撑,继续看好债市的未来一年内的相对确定的债券行情。近日银行理财收益率缓慢下调,均值跌破4.5%,这一收益率水平也是社会重要的无风险利率之一,这将是债券继续走好的同步指标,具有明显的指示作用。考虑到股市和债市的联动,我们倾向于认为股市有改善但空间受限,而债市可能出现波动,但仍在较为确定的路径上。从风险角度看,当前重要的是杠杆风险和信用风险,银行间和交易所的融资回购总余额不断攀升,表明在缺货资产环境下,杠杆操作的机构在上升,杠杆度比较高,对回购利率的边际博弈会放大资金利率的的波动范围,从而如果再叠加其他因素,债市出现交易氛围的骤降或者收益率的10-15个BP级别的上升是可能的。

对于经济而言,克强总理一直重视,近期力推新能源车、简政放权、PPP项目,而从数据上可以看到近三个月来财政投入在加大,传统的靠货币政策放钱推动投资和产能扩张的老路越来越低效,财政政策理应做出更大的贡献;看未来一年,经济能否筑底,转型能否推进,财政政策的力度值得重视。

可转债目前价值依然不大,5个点以下谨慎参与。在连续深跌之后,股市风险偏好略有好转,区间震荡是主流观点。我们认为底部可以逐步抬高,整体上适宜较高仓位。10月下旬召开的五中全会和随后的十三五规划对于主题投资有刺激作用,加上公募和私募权益上的较低仓位,市场心态支持四季度走出一小波上扬行情。

本基金将努力在相对较低风险的前提下,做好大类资产配置,从中期把握转换时机,精选投资品种,保持组合灵活性。合理地承担有价值的风险,力争为持有创造持续稳定优良的投资业绩。

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	712,414,145.01	96.46
	其中:债券	712,414,145.01	96.46
	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	11,915,701.66	1.61
7	其他资产	14,203,377.82	1.92
8	合计	738,533,224.49	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	102,014,000.00	16.66
	其中:政策性金融债	102,014,000.00	16.66
4	企业债券	323,309,577.01	52.80
5	企业短期融资券	210,473,000.00	34.37
6	中期票据	61,068,000.00	9.97
7	可转债	15,549,568.00	2.54
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	712,414,145.01	116.35

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	150210	15国开10	500,000	52,020,000.00	8.50
2	011507004	15南电SCP004	400,000	39,972,000.00	6.53
3	101559006	15广州港股MTN001	300,000	30,561,000.00	4.99
4	041554026	15国电集CP002	300,000	30,231,000.00	4.94
5	041555013	15陕延油CP001	300,000	30,219,000.00	4.94

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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	26,857.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,085,080.42
5	应收申购款	3,091,440.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,203,377.82

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	5,171,200.00	0.84

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:本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富实业债债券A	汇添富实业债债券C
报告期期初基金份额总额	129,210,483.07	48,430,756.86
报告期期间基金总申购份额	521,221,709.73	125,819,444.11
减:报告期期间基金总赎回份额	219,097,335.59	84,519,436.73
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	431,334,857.21	89,730,764.24

注: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 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实业债债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富实业债债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富实业债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、报告期内汇添富实业债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

汇添富收益快钱货币市场基金

2015年9月30日

[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	汇添富收益快钱货币	
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22日	
报告期末基金份额总额	5,354,393.00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	2,580,796.00份	2,773,597.00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7月1日 - 2015年9月30日)	
	添富快钱A	添富快钱B
1. 本期已实现收益	1,151,969.60	1,235,750.20
2. 本期利润	1,151,969.60	1,235,750.20
3. 期末基金资产净值	258,079,600.00	277,359,700.00

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

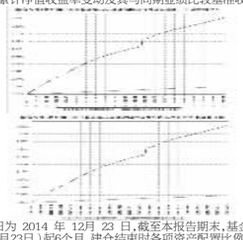
添富快钱A

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	0.5612%	0.0016%	0.0882%	0.0000%	0.4730%	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	0.6221%	0.0016%	0.0882%	0.0000%	0.5339%	0.0016%

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,建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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		
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,历任固定收益高级经理、固定收益基金经理助理,现任固定收益投资总监。2008年3月6日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理,2009年1月21日至2011年6月21日任汇添富货币基金的基金经理,2011年1月26日至2013年2月7日任汇添富保本混合基金的基金经理,2012年7月26日至今任汇添富季季红定期开放债券基金的基金经理,2013年11月6日至今任汇添富互利分级债券基金的基金经理,2013年12月13日至2015年3月31日任汇添富全额宝货币基金的基金经理,2014年1月21日至2015年3月31日任汇添富收益快钱货币基金的基金经理,2014年12月23日至今任汇添富收益快钱货币基金的基金经理。
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12月23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均执行情况良好。

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年三季度,国际市场方面,全球经济放缓。强势美元和海外需求疲软对美国经济造成冲击凸显,非农就业数据进一步回落并大幅低于市场预期,美联储加息概率不断下降;国内市场方面,经济依旧低迷,而9月以来物价指数重新回落,通缩风险有所升温。人民币持续贬值对三季度资金面造成持续承压,央行通过降准、SLO、MLF、逆回购等方式投放超万亿流动性,对冲资本外流。

债券市场方面,三季度受股市下跌资金回流以及IPO暂停背景下打新基金加大固定收益类产品配置力度的影响下,银行间货币利率保持低位,各期限债券品种百花齐放,收益率均持续下行,牛市行情得以延续。信用利差也进一步收缩,其中高等级信用债已处于09年以来的历史低位,信用品种收益率下行幅度超过30BP。

就本基金操作而言本基金以稳健操作为准。在三季度及时捕捉到持有人申赎安排,以流动性管理为首要任务。此外,在七月初小幅加仓高评级短融,并配合较短久期的回购以及存款应对资金面冲击,在降低组合的风险的同时为持有人获取稳定回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年三季度本基金A 级净值收益率为0.5612%,B 级净值收益率为0.6221%。

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4季度,宏观经济形势仍不容乐观,9月以来物价指数重新回落,通缩风险有所升温,经济下行压力在所难免,为实现全年稳增长的目标,降准降息等宽松货币政策有望再度释放,流动性整体无忧。因此债券市场收益率仍将保持震荡下行为主,收益率曲线将进一步平坦化,但同时不排除年底资金面紧张带来一定调整的可能。在把握交易性机会的同时,警惕一旦快速调整或将引发踩踏序带来的连锁反应,因此配置上仍将着重关注短久期、中高等级品种,保证较高的安全边际。

近年来,预计场内基金的规模波动将会增大。在四季度,我们将严格控制风险,预兼顾流动性和收益性目标,对组合资产进行积极调整,力争在控制风险的前提下为投资者创造持续稳定的收益。在做好流动性管理的同时,择机把握中高等级短期融资券以及短期利率债的交易型机会,提高组合收益。

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	60,016,092.05	11.20
	其中:债券	60,016,092.05	11.20
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	50,477,966.26	9.42
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	50,477,966.26	9.42
3	银行存款和结算备付金合计	423,864,476.53	79.09
4	其他资产	1,591,461.71	0.30
5	合计	535,949,996.55	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	0.44
	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: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	30
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	65
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

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120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	66.55	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	20.17	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	1.87	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	9.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	1.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.79	-

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	19,996,329.75	3.73
	其中:政策性金融债	19,996,329.75	3.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,019,762.30	7.47
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	60,016,092.05	11.21
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	011599225	15阳泉SCP001	200,000	20,035,984.53	3.74
2	140230	14国开30	100,000	9,999,619.21	1.87
3	011537002	15中建材SCP002	100,000	9,999,180.13	1.87
4	150403	15农发03	100,000	9,996,710.54	1.87
5	041562017	15亚邦CP002	100,000	9,984,597.64	1.86

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	0.1769%
报告期内偏离度的最低值	0.0697%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1050%

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

本报告期内本基金未持有剩余期限小于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

本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	1,566,180.78
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	25,280.93
7	其他	-
8	合计	1,591,461.71

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	添富快钱A	添富快钱B
报告期期初基金份额总额	1,976,134.00	1,021,336.00
报告期期间基金总申购份额	58,239,710.00	19,907,740.00
减:报告期期间基金总赎回份额	57,635,048.00	18,155,479.00
报告期期末基金份额总额	2,580,796.00	2,773,597.00

注:总申购份额含因份额升降级、二级市场买入等导致的强制强增份额。总赎回份额含因份额升降级、二级市场卖出等导致的强制调减份额。

§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收益快钱货币市场基金募集的文件;

2、《汇添富收益快钱货币市场基金基金合同》;

3、《汇添富收益快钱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、报告期内收益快钱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。

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

汇添富收益快线货币市场基金

2015年9月30日

[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	汇添富收益快线货币
交易代码	519888
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月21日
报告期末基金份额总额	6,675,598,362,969.00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	本基金的投资将遵循安全性和流动性优先原则,以宏观经济和货