汇添富理财30天债券型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31日

基金管理人：汇添富基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2013年4月19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2013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2013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	4,635,099,267.57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	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	汇添富理财30天A	汇添富理财30天B
下属两级基金的交易代码	470030	471030
报告期末下属两级基金的份额总额	2,733,038,208.06份	1,902,061,059.51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（2013年1月1日 － 2013年3月31日）	
	汇添富理财30天A	汇添富理财30天B
1. 本期已实现收益	30,854,091.10	16,810,137.79
2.本期利润	30,854,091.10	16,810,137.79
3.期末基金资产净值	2,733,038,208.06	1,902,061,059.51

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	0.9034%	0.0029%	0.3329%	0.0000%	0.5705%	0.0029%

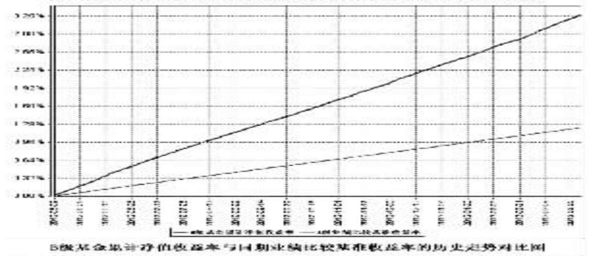
注：1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。2、本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

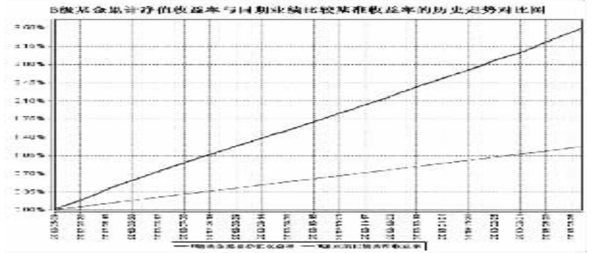
汇添富理财30天B

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	0.9758%	0.0029%	0.3329%	0.0000%	0.6429%	0.0029%

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：本基金的《基金合同》生效日为2012年5月9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（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		
曾刚	本基金的基金经理，汇添富理财60天债券的基金经理，汇添富多元收益债券的基金经理，汇添富理财28天债券的基金经理，汇添富理财21天债券发起式的基金经理，汇添富可转换债券的基金经理，固定收益投资副总监。	2012年5月9日	–	12年	国籍：中国，1971年出生，中国科技大学学士，清华大学MBA。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾在红塔证券自营业务总部、汉唐证券债券业务总部、华宝兴业基金管理有限公司研究部负责宏观经济和债券的研究、上海电气集团财务有限责任公司资产管理部任经理助理，2008年5月15日至2010年2月5日任华富基金管理有限公司华富货币基金的基金经理，2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强债券基金的基金经理，2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报债券基金的基金经理。2011年11月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程部高级经理，现任固定收益投资副总监。2012年5月9日至今任汇添富理财30天债券型证券投资基金的基金经理，2012年6月12日至今任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理，2012年9月18日至今任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理，2012年10月18日至今任汇添富理财28天债券型证券投资基金的基金经理，2013年1月24日至今任汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金的基金经理，2013年2月7日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。

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

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》，公司制定了同日反向交易控制的规则，同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内，本公司管理的所有投资组合未发生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%的情形。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

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

2013年一季度国内宏观经济数据喜忧参半，投资与出口较高，而消费低迷，实体企业数据不强，多数专业机构认为是弱复苏；同期央行公开市场操作虽然有小的变化，但整体上维持宽松，社会融资总量同比有显著的增长，资金利率继续处于较低水平，隔夜回购利率波动区间集中在2-2.5%，一月期银行间同业拆放利率（shibor1M）在3.3-4%的区间内波动。一季度银行刚性配置需求旺盛，债券托管量明显上升，1-2月份债市强势上涨，3月份小幅振荡，在银监会八号文的推动下，收益率再度下行，AAA短融的市场收益率从去年末的4.45%，最低至3.8%。由于资金充沛，同业存款利率持续走低，与短融相比其配置价值有所下降。

本期内，本基金整体较为平稳，受益于债市上涨，组合中浮盈提高，组合收益表现较为均衡，基金规模趋于稳定。本基金相应地减少了存款的配置，调整了债券结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

一季度本基金A级净值收益率为0.9034%，B级净值收益率为0.9758%。

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，我们认为宏观经济以稳为主，改革进入深水区，难度较大，民生与环保负担较重，多项政策集中推出，执行力度有待观察，二季度重点关注新型城镇化的具体规划，预计固定资产投资增速仍保持在较高水平，通胀压力不大，可以关注二季度末CPI是否会走高。二季度央行公开市场操作存在出现变化的时间窗口，但预计不会有大的调整，资金面将保持宽松。二季度债市负面因素不多，新增供应量和信用风险可能减缓收益率下行的步伐，我们预期短融率能稳定在当前的大区间内，可以适度配置。

我们将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。本基金的组合流动性管理特征不同于普通货币基金，我们将更加明确地注重流动性，做好份额变动的分析和预测，合理搭配协存、短融、浮息债等品种，力争提高组合收益。

§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	1,938,932,691.98	39.68
	其中：债券	1,938,932,691.98	39.68
	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	2,816,238,604.54	57.64
4	其他资产	130,958,044.74	2.68
5	合计	4,886,129,341.26	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	6.66	
	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	239,399,760.30	5.16
	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：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	80
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	54

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	26.50	5.16
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.51	–
2	30天(含)-60天	16.20	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)-90天	22.87	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.22	–
4	90天(含)-180天	31.23	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	7.70	–
5	180天(含)-397天（含）	7.13	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	103.93	5.16

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	687,240,462.81	14.83
	其中：政策性金融债	687,240,462.81	14.83
4	企业债券	55,542,282.67	1.20
5	企业短期融资券	1,196,149,946.50	25.81
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	1,938,932,691.98	41.83
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	436,950,055.64	9.43

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	3,600,000	357,106,362.52	7.70
2	120228	12国开28	1,300,000	129,951,760.65	2.80
3	041259058	12国电集CP003	1,000,000	100,039,631.69	2.16
4	041251015	12铁道CP001	850,000	85,037,179.23	1.83
5	080210	08国开10	800,000	80,344,409.01	1.73
6	041251019	12浙物产CP001	700,000	70,006,805.63	1.51
7	120233	12国开33	700,000	69,847,751.20	1.51
8	041253026	12东阳光CP001	600,000	60,055,923.71	1.30
9	041254021	12利港CP001	500,000	50,066,037.07	1.08
10	041262020	12富通CP001	500,000	50,030,002.80	1.08

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	0.17%
报告期内偏离度的最低值	-0.07%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.11%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	5,225.59
2	应收证券清算款	62,146,432.19
3	应收利息	63,560,578.37
4	应收申购款	5,245,808.59
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	130,958,044.74

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富理财30天A	汇添富理财30天B
本报告期期初基金份额总额	4,556,888,049.63	2,153,912,809.70
本报告期基金总申购份额	748,941,341.35	1,369,881,404.68
减:本报告期基金总赎回份额	2,572,791,182.92	1,621,733,154.87
本报告期期末基金份额总额	2,733,038,208.06	1,902,061,059.51

§7 备查文件目录

7.1 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。

7.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理有限公司

7.3 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。

汇添富基金管理有限公司
2013年4月19日

汇添富理财60天债券型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31日

基金管理人：汇添富基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2013年4月19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2013年4月16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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富理财60天债券	
基金主代码	470060	
交易代码	470060	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年6月12日	
报告期末基金份额总额	765,111,992.12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，将投资组合的平均剩余期限控制在180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，高于货币市场型证券投资基金。	
基金管理人	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	汇添富理财60天债券A	汇添富理财60天债券B
下属两级基金的交易代码	470060	471060
报告期末下属两级基金的份额总额	719,477,505.95份	45,634,486.17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（2013年1月1日 － 2013年3月31日）	
	汇添富理财60天债券A	汇添富理财60天债券B
1. 本期已实现收益	7,832,461.85	71,552.10
2.本期利润	7,832,461.85	71,552.10
3.期末基金资产净值	719,477,505.95	45,634,486.17

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60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	0.9065%	0.0041%	0.3329%	0.0000%	0.5736%	0.0041%

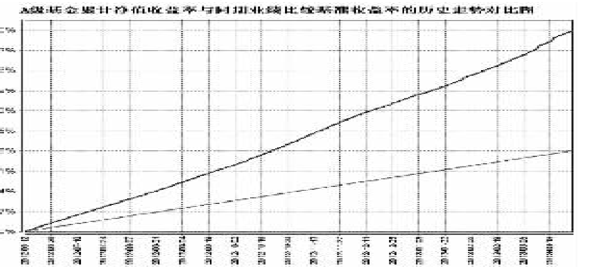
注：1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。
2、本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

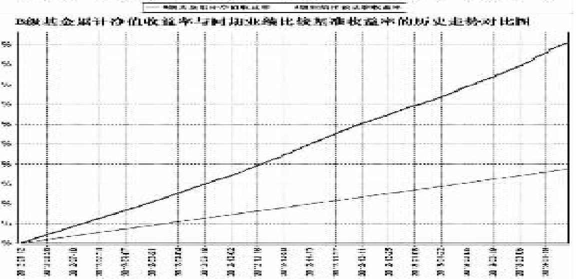
汇添富理财60天债券B

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	0.9787%	0.0041%	0.3329%	0.0000%	0.6458%	0.0041%

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：本基金的《基金合同》生效日为2012年6月12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（2012年6月12日）起五日，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		
曾刚	本基金的基金经理，汇添富理财30天债券的基金经理，汇添富多元收益债券的基金经理，汇添富理财28天债券的基金经理，汇添富理财21天债券发起式的基金经理，汇添富可转换债券的基金经理，固定收益投资副总监。	2012年6月12日	–	12年	国籍：中国，1971年出生，中国科技大学学士，清华大学MBA。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾在红塔证券自营业务总部、汉唐证券债券业务总部、华宝兴业基金管理有限公司研究部负责宏观经济和债券的研究、上海电气集团财务有限责任公司资产管理部任经理助理，2008年5月15日至2010年2月5日任华富基金管理有限公司华富货币基金的基金经理、2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强债券基金的基金经理、2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报债券基金的基金经理。2011年11月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程部高级经理，现任固定收益投资副总监。2012年5月9日至今任汇添富理财30天债券型证券投资基金的基金经理，2012年6月12日至今任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理，2012年9月18日至今任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理，2012年10月18日至今任汇添富理财28天债券型证券投资基金的基金经理，2013年1月24日至今任汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金的基金经理，2013年2月7日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。

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

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》，公司制定了同日反向交易控制的规则，同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内，本公司管理的所有投资组合未发生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%的情形。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

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

2013年一季度国内宏观经济数据喜忧参半，投资与出口较高，而消费低迷，实体企业数据不强，多数专业机构认为是弱复苏；同期央行公开市场操作虽然有小的变化，但整体上维持宽松，社会融资总量同比有显著的增长，资金利率继续处于较低水平，隔夜回购利率波动区间集中在2-2.5%，一月期银行间同业拆放利率（shibor1M）在3.3-4%的区间内波动。一季度银行刚性配置需求旺盛，债券托管量明显上升，1-2月份债市强势上涨，3月份小幅振荡，在银监会八号文的推动下，收益率再度下行，AAA短融的市场收益率从去年末的4.45%，最低至3.8%。由于资金充沛，同业存款利率持续走低，与短融相比其配置价值有所下降。

本期内，本基金整体较为平稳，受益于债市上涨，组合中浮盈提高，组合收益较前期有所提高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

一季度本基金A级净值收益率为0.9065%，B级净值收益率为0.9787%。

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，我们认为宏观经济以稳为主，改革进入深水区，难度较大，民生与环保负担较重，多项政策集中推出，执行力度有待观察，二季度重点关注新型城镇化的具体规划，预计固定资产投资增速仍保持在较高水平，通胀压力不大，可以关注二季度末CPI是否会走高。二季度央行公开市场操作存在出现变化的时间窗口，但预计不会有大的调整，资金面将保持宽松。二季度债市负面因素不多，新增供应量和信用风险可能减缓收益率下行的步伐，我们预期短融率能稳定在当前的大区间内，可以适度配置。

我们将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。本基金的组合流动性管理特征不同于普通货币基金，我们将更加明确地注重流动性，做好份额变动的分析和预测，合理搭配协存、短融、浮息债等品种，力争提高组合收益。

§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	313,205,698.90	40.66
	其中：债券	299,205,698.90	38.84
	资产支持证券	14,000,000.00	1.82
2	买入返售金融资产	1,000,000.00	0.13
	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	441,365,969.28	57.30
4	其他资产	14,690,647.57	1.91
5	合计	770,262,315.75	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	4.27	
	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	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	132
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	68

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	31.22	0.13
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.16	–
2	30天(含)-60天	1.30	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)-90天	35.68	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)-180天	27.41	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.18	–
5	180天(含)-397天（含）	3.14	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	98.75	0.13

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	119,192,814.68	15.58
	其中：政策性金融债	119,192,814.68	15.58
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	180,012,884.22	23.53
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	299,205,698.90	39.11
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	79,100,395.86	10.34

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	041258040	12中交建CP002	500,000	49,999,870.45	6.53
2	041272002	12富邦CP001	400,000	39,985,314.65	5.23
3	120227	12国开27	400,000	39,599,771.93	5.18
4	120233	12国开33	400,000	39,500,623.93	5.16
5	080210	08国开10	300,000	30,129,153.38	3.94
6	041262021	12伟星CP001	200,000	20,019,746.56	2.62
7	041253037	12联通CP001	200,000	20,002,795.28	2.61
8	041260087	12济宁供水CP001	100,000	10,004,147.50	1.31
9	041260029	12星期六CP001	100,000	10,000,479.06	1.31
10	041253042	12深茂业CP002	100,000	10,000,263.22	1.31

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	13
报告期内偏离度的最高值	0.28%
报告期内偏离度的最低值	-0.09%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.17%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	119023	侨城01	140,000.00	14,000,000.00	1.83

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	2,659.77
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	14,167,487.80
4	应收申购款	520,500.00
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	14,690,647.57

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富理财60天债券A	汇添富理财60天债券B
本报告期期初基金份额总额	1,070,863,023.04	5,598,258.68
本报告期期间基金总申购份额	38,244,866.32	40,036,227.49
减:本报告期期间基金总赎回份额	389,630,383.41	–
本报告期期末基金份额总额	719,477,505.95	45,634,486.17

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富理财60天债券型证券投资基金募集的文件；
2、《汇添富理财60天债券型证券投资基金基金合同》；
3、《汇添富理财60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60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。

7.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理有限公司

7.3 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。

汇添富基金管理有限公司
2013年4月19日

汇添富多元收益债券型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31日

基金管理人：汇添富基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2013年4月19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2013年4月16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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富多元收益债券	
交易代码	470010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年9月18日	
报告期末基金份额总额	1,051,168,057.37份	
投资目标	本基金主要投资于债券类固定收益品种，在承担合理风险和保持资产流动性的基础上，适度参与权益类资产投资，力争实现资产的长期稳定增值。	
投资策略	基金的投资组合比例为：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%，权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，持有的现金或到期日在1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* 90% + 沪深300指数 * 10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	汇添富多元收益债券A	汇添富多元收益债券C
下属两级基金的交易代码	470010	470011
报告期末下属两级基金的份额总额	782,629,806.89份	268,538,250.48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（2013年1月1日 － 2013年3月31日）	
	汇添富多元收益债券A	汇添富多元收益债券C
1.本期已实现收益	4,035,645.82	2,079,778.71
2.本期利润	32,606,431.48	13,152,649.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.0415	0.0432
4.期末基金资产净值	842,338,840.70	288,245,780.86
5.期末基金份额净值	1.076	1.073

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

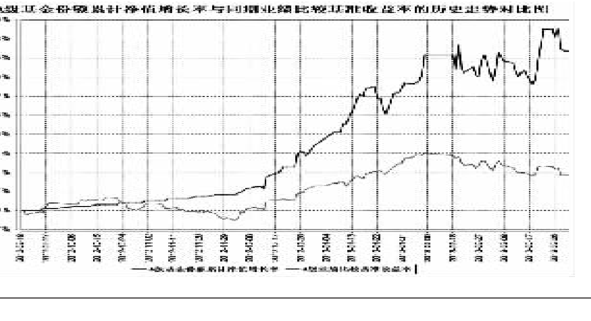
汇添富多元收益债券A

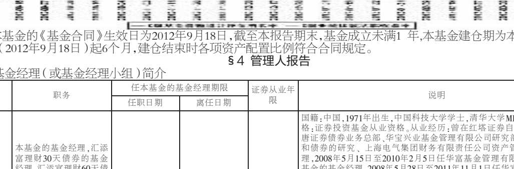
阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去三个月	4.66%	0.50%	0.52%	0.16%	4.14%	0.34%

汇添富多元收益债券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	4.57%	0.51%	0.52%	0.16%	4.05%	0.35%

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：本基金的《基金合同》生效日为2012年9月18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（2012年9月18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		
曾刚	本基金的基金经理，汇添富理财30天债券的基金经理，汇添富理财60天债券的基金经理，汇添富理财28天债券的基金经理，汇添富理财21天债券发起式的基金经理，汇添富可转换债券的基金经理，固定收益投资副总监。	2012年9月18日	–	12年	国籍：中国，1971年出生，中国科技大学学士，清华大学MBA。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾在红塔证券自营业务总部、汉唐证券债券业务总部、华宝兴业基金管理有限公司研究部负责宏观经济和债券的研究、上海电气集团财务有限责任公司资产管理部任经理助理，2008年5月15日至2010年2月5日任华富基金管理有限公司华富货币基金的基金经理，2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强债券基金的基金经理，2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报债券基金的基金经理。2011年11月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程部高级经理，现任固定收益投资副总监。2012年5月9日至今任汇添富理财30天债券型证券投资基金的基金经理，2012年6月12日至今任汇添富理财60天债券型证券投资基金的基金经理，2012年9月18日至今任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理，2012年10月18日至今任汇添富理财28天债券型证券投资基金的基金经理，2013年1月24日至今任汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金的基金经理，2013年2月7日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。

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

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》，公司制定了同日反向交易控制的规则，同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易分析。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合未发生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%的情形。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

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

一季度经济数据喜忧参半，固定资产投资与进出口仍保持一定强势，消费增长偏低，工业增加值和用电量所反映的实体企业经营状况则呈现弱势，货币政策仍然较为宽松，社会融资总量保持较快增长，资金利率处于相对低位，而通胀压力本期有所减弱。3月份的两会显示了新一届政府的务实态度，着眼于改革红利，寄望于新型城镇化，但同时也强调改革进入深水区，需要更注重民生和环保，实现有质量的增长，可以接受略低的GDP。再看外围，美国各项数据都在转好，失业率进一步下降，IMF调高了美国经济增长的预期目标；欧洲脱离了欧债危机以来最严峻的时期，缓步上行，但救助方案上各国持续博弈可能减缓恢复的势头；日本急于用最大剂量的量化宽松政策来刺激经济，力促贬值，将通胀目标调至2%，对周边各国将带来一定压力。整体上，国内经济处于弱复苏的过程中，各方的解读和预期出现差异，一季度后期股市走弱，而债市走强。

在央行偏稳的政策预期下，经济不强，通胀减弱，资金宽松，债券供不应求，1月份债市大幅上涨，中间虽有小调整，但在银监会八号文的推动下，理财产品将扩大标准债权类资产的配置，债市继续转强，长端收益率较去年末再次下行。

春节长假前，股市呈现普涨格局，医药、银行、军工等行业涨幅抢眼；长假后，房地产调控政策持续发酵，金融地产领跌，中小板和创业板估值偏高但个股活跃。一季度可转债先涨后跌，美丰转债强势促转股，带动市场估值上行，但随后在股指回调的格局下，出现分化，电力与医药转债相对更为稳健。

一季度本基金重点增持了可转债，重仓品种仍是国投和石化，在纯债配置方面继续偏慢的配置节奏，保持组合流动性，股票方面维持相对较高的仓位，以具备良好基本面的医药类个股为重，整体上获得了较好的收益，但受制于偏权益类的震荡，基金净值的波动较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

一季度本基金A级净值收益率为4.66%，C级净值收益率为4.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济弱复苏还是温和复苏的争论主导了一季度的投资市场，政府换届的同时，地产调控引发关注、各监管部门政策力度加强、禽流感、朝鲜半岛风波加剧了不安定的预期。我们认为国内经济走上温和复苏的轨道是大概率事件，二季度数据可能逐步印证复苏的强度。二季度重点关注新型城镇化的具体规划，预计固定资产投资增速仍保持在较高水平，通胀压力不大，可以关注二季度末CPI是否会走高。二季度央行公开市场操作存在出现变化的时间窗口，但预计不会有大的调整。目前的信用利差已处于历史最低水平，新债资质下沉趋势明显，债市机会有限，保持组合灵活性更为必要。

可转债市场已经远离去年四季度初的高收益低风险阶段，转为部分优势个券促转股行情下，高风险中等收益的阶段，在600多亿潜在新增供给的压力下，需把握好个券，稳中求进。

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。

§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	174,648,502.82	10.23
	其中：股票	174,648,502.82	10.23
2	固定收益投资	1,477,281,887.55	86.49
	其中：债券	1,452,946,887.55	85.07
	资产支持证券	24,335,000.00	1.42
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	24,028,614.00	1.41
6	其他资产	32,035,199.68	1.88
7	合计	1,707,994,204.05	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	3,005,000.00	0.27
B	采掘业	9,189,500.00	0.81
C	制造业	120,065,412.12	10.62
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	–	–
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	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	28,532,590.70	2.52
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	13,856,000.00	1.23
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	174,648,502.82	15.45

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	600422	昆明制药	1,674,449	40,103,053.55	3.55
2	600085	同仁堂	1,634,965	36,852,111.10	3.26
3	300124	汇川技术	1,285,411	33,510,664.77	2.96
4	601888	中国国旅	460,340	15,182,013.20	1.34
5	002344	海宁皮城	410,787	13,350,577.50	1.18
6	000888	峨眉山A	400,000	8,672,000.00	0.77
7	000915	山大华特	270,942	5,920,082.70	0.52
8	000937	冀中能源	450,000	5,494,500.00	0.49
9	002033	丽江旅游	300,000	5,184,000.00	0.46
10	600028	中国石化	500,000	3,695,000.00	0.33

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	90,165,000.00	7.98
	其中：政策性金融债	90,165,000.00	7.98
4	企业债券	651,618,653.88	57.64
5	企业短期融资券	30,246,000.00	2.68
6	中期票据	–	–
7	可转债	680,917,233.67	60.23
8	其他	–	–
9	合计	1,452,946,887.55	128.51

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	110015	石化转债	1,980,850	221,934,434.00	19.63
2	110013	国投转债	1,539,160	206,832,320.80	18.29
3	110022	同仁转债	434,410	57,541,948.60	5.09
4	110023	N民生转	427,370	45,267,030.40	4.00
5	127001	海直转债	369,389	44,252,432.81	3.91

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	061202001	12通元1A	500,000	24,335,000.00	2.15

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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。

5.8.2

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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	403,989.76
2	应收证券清算款	3,096,210.28
3	应收股利	–
4	应收利息	14,562,553.58
5	应收申购款	13,972,446.06
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	32,035,199.68

5.8.4 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	110015	石化转债	221,934,434.00	19.63
2	110013	国投转债	206,832,320.80	18.29
3	113003	重工转债	40,369,945.50	3.57
4	110018	国电转债	26,501,467.20	2.34
5	110012	海运转债	4,052,413.00	0.36

5.8.5 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	汇添富多元收益债券A	汇添富多元收益债券C
本报告期期初基金份额总额	235,584,927.14	281,316,698.12
本报告期基金总申购份额	1,362,739,360.83	333,671,898.10
减:本报告期基金总赎回份额	815,694,481.08	346,450,345.74
本报告期基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	782,629,806.89	268,538,250.48

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富多元收益债券型证券投资基金募集的文件；
2、《汇添富多元收益债券型证券投资基金基金合同》；
3、《汇添富多元收益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、报告期内汇添富多元收益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。

7.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理有限公司

7.3 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。

汇添富基金管理有限公司
2013年4月19日