汇添富高息债债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月24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2013年10月22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	391,969,759.60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+)至AA(含AA)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	汇添富基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	汇添富高息债债券A / 汇添富高息债债券C
下属两级基金的交易代码	000174 / 000175
报告期末下属两级基金的份额总额	261,335,623.97份 / 130,634,135.63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7月1日 - 2013年9月30日)	
	汇添富高息债债券A	汇添富高息债债券C
1.本期已实现收益	6,935,776.31	7,499,663.74
2.本期利润	6,931,291.38	7,512,453.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0166	0.0163
4.期末基金资产净值	265,850,695.27	132,698,007.58
5.期末基金份额净值	1.017	1.016

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

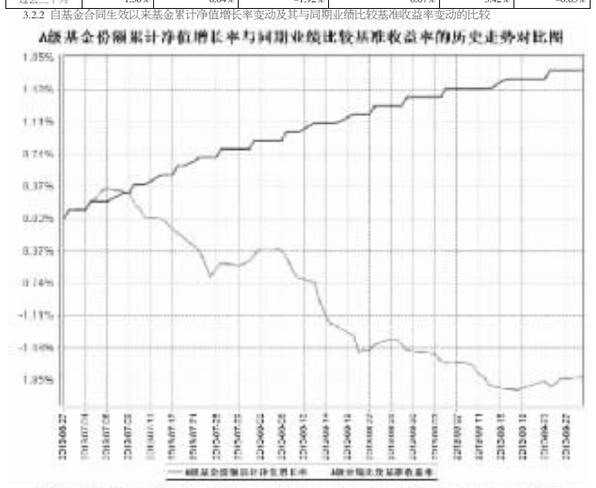
汇添富高息债债券A

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	1.60%	0.04%	-1.92%	0.07%	3.52%	-0.03%

汇添富高息债债券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	1.50%	0.04%	-1.92%	0.07%	3.42%	-0.03%

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2013年6月27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(2013年6月27日)起6个月,截止本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

§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	汇添富保本混合基金的基金经理,汇添富收益快线货币基金的基金经理,汇添富信用债债券基金的基金经理,汇添富高息债债券基金的基金经理,汇添富年年利定期开放债券型基金的基金经理。	2013年6月27日	-	12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型证券投资基金的基金经理,2009年4月2日到2010年5月9日任农银汇理平衡双利混合型证券投资基金的基金经理。2012年3月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程部高级经理,2012年12月21日至今任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理,2013年6月27日至今任汇添富高息债债券型证券投资基金的基金经理,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%的交易次数共9次,其中因指数基金建仓发生7次、因专户到期清盘发生1次、因专户现金分红发生1次,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

3季度或许将成为中国债券市场的一个转折期。"6.20"钱荒致使市场资金利率脉冲式上扬,股债双杀。惊魂未定中市场迈入3季度。各受关注的资金利率并未如市场预期在季末后大幅下滑,尽管银行间7天回购利率由月末11.5%的高位下降至4%左右,比原先平均的3%-3.5%高出不多,但6个月长三角票据贴现利率并未相应大幅下滑,6月末的高位在9.5%,7月初下滑后仍在5-5.5%左右,比之前的平均3.5%-4%仍高出许多。究其原因,央行的操作是关键,央行7月初"默默"的央票续发行充分表明了其在当下环境中并不希望资金太宽裕,从而维持较高资金利率以促进解杠杆、降风险的态度。从经济基本面来说,经历2季度经济较快的下滑,政府对经济增长的担忧上升,"上下限"理论的出台以及后期PMI、工业增加值的超预期,稳定、提升了市场对经济增长的良好预期。此外,利率市场化的推进,以及银监会8号文的出台,对银行等债券主力投资机构的投资策略产生重要影响,利率市场化的逐步推进,使得银行对其资金成本上升的预期开始增强,提高了对投资标的收益率的要求,而一般债券的收益率相对偏低,因此一般债券的需求实际下降,非标资产成为银行较钟情的目标,8号文的出台,理论上增加了对标准债券资产的需求,但由于理财产品发行量的相对下降,对一般债券的需求实际上也是相对有所降低的。

在此背景下,经历6月下旬的暴跌,股市在3季度温和复苏,其中,创业板创历史新高,上涨35.21%,上证50上涨5.84%。债券市场,在叠加利率债供应放量,公司债供应预期较少,城投债4季度供应可能放量的影响下有所分化,季初到季末,10年期国债收益率由3.52%上升至4.03%,期间曾上冲到4.13%以上,5年债项AA+信用债由5.2%上升到5.85%,利率债以及高等级信用债受冲击较大,短融以及高票息的信用债整体受影响较小。

本基金6月27日成立,成立初期,基于对资金利率高企、债市偏弱的判断,重点配置高利率的存款,基本不配债券,避开了债市的回调,获得较高收益。封闭期结束后,逐步加大债券配置力度,同时,权极利用月末资金紧张效应,继续合理安排协议存款,为持有人提高较稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年三季度本基金A级净值收益率为1.60%,C级净值收益率为1.50%,同期业绩比较基准收益率为-1.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前,我国经济发展处于关键期,有稳增长的需要,更有促转型的压力。为促进转型,央行更可能倾向于维持资金的紧平衡,这样资金利率维持高位可能将会在较长时期里存在,而在利率市场化的背景下,银监会8号文以及允许部分银行进行资产管理试点的开闸,则很可能会进一步改变银行等机构的投资行为。宏观经济在促转型背景下的主动下滑倒显得不是那么太重要。未来,本基金将努力把握市场脉搏,在综合考虑上述因素以及债券供求等因素的基础上择机加大债券持仓,优选风险可控的高息债积极配置,努力为持有人创造收益。

§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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	75,373,333.20	18.24
	其中:债券	75,373,333.20	18.24
	资产支持证券	-	-
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	331,041,968.86	80.12
6	其他资产	6,758,839.43	1.64
7	合计	413,174,141.49	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	10,015,000.00	2.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	65,358,333.20	16.40
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	75,373,333.20	18.91

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	019302	13国债02	100,000	10,015,000.00	2.51
2	112190	11亚迪02	100,000	10,000,000.00	2.51
2	123012	13哈高新债	100,000	10,000,000.00	2.51
2	124337	13铜建投	100,000	10,000,000.00	2.51
2	124343	13皖江债	100,000	10,000,000.00	2.51
3	112059	11联化债	62,060	6,361,150.00	1.60
4	122142	11鹿港债	63,680	6,354,627.20	1.59
5	122965	09维投债	45,050	4,529,777.50	1.14

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

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.8.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.8.2 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。

5.8.3 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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,070.35
2	应收证券清算款	4,994,856.36
3	应收股利	-
4	应收利息	1,531,121.63
5	应收申购款	231,791.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,758,839.43

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.9.5 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	汇添富高息债债券A	汇添富高息债债券C
报告期期初基金份额总额	476,079,649.61	619,317,593.63
报告期期间基金总申购份额	1,909,146.10	8,221,652.95
减:报告期期间基金总赎回份额	216,653,171.74	496,905,110.95
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	261,335,623.97	130,634,135.63

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理的基金。

§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高息债债券型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富高息债债券型证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富高息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、报告期内汇添富高息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。

汇添富基金管理有限公司
2013年10月24日

汇添富实业债债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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10月24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10月22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	1,507,585,968.33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	汇添富实业债债券A / 汇添富实业债债券C
下属两级基金的交易代码	000122 / 000123
报告期末下属两级基金的份额总额	1,159,600,500.91份 / 347,985,467.42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7月1日 - 2013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	19,622,227.78	9,019,617.16
2.本期利润	19,028,776.37	8,860,093.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.0130	0.0128
4.期末基金资产净值	1,178,076,296.25	353,040,918.57
5.期末基金份额净值	1.016	1.015

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

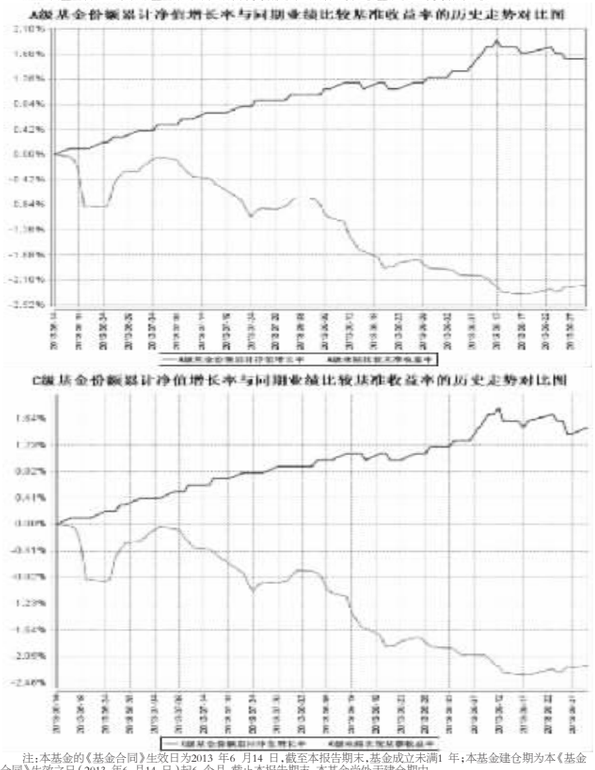
汇添富实业债债券A

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	1.30%	0.07%	-1.92%	0.07%	3.22%	0.00%

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	1.20%	0.07%	-1.92%	0.07%	3.12%	0.00%

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2013年6月14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(2013年6月14日)起6个月,截止本报告期末,本基金尚处于建仓期中。

§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	汇添富理财30天、理财60天、理财28天、理财21天、理财7天的基金经理,汇添富理财14天的基金经理助理,汇添富多元收益、可转换债券、实业债债券、汇添富现金宝货币的基金经理,固定收益投资副总监。	2013年6月14日	-	12年	国籍:中国。学历: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、华宏兴业基金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天基金的基金经理,2012年6月12日至今任汇添富理财60天基金的基金经理,2012年7月10日至今任汇添富理财14天基金的基金经理助理,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日至今任汇添富理财28天基金的基金经理,2013年1月24日至今任汇添富理财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日至今任汇添富理财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至今任汇添富现金宝货币基金的基金经理。

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%的交易次数共9次,其中因指数基金建仓发生7次、因专户到期清盘发生1次、因专户现金分红发生1次,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

2013年三季度国内经济呈现弱复苏态势,PMI、工业增加值等经济指标逐月上行,房地产、基建投资等终端需求有所恢复。经济增长在下了一个台阶之后出现低位企稳回升态势,投资者对于宏观经济的悲观预期有所缓和。流动性方面,央行在6月底的钱荒之后加大了对市场短期流动性的维护力度,三季度的流动性环境整体偏宽松。因此,A股市场总体面临相对有利的外部环境,而宏观层面的改革预期与微观层面持续不断的并购潮则提供了大量的结构性和主题性的投资机会。三季度市场大幅上涨,沪深300上涨9.5%,中小板指数上涨17.5%,创业板指数上涨35.2%。分行业来看,涨幅居前的行业为信息服务、商业贸易、餐饮旅游、信息设备和交通运输,而建筑建材、公用事业、采掘、食品饮料、钢铁等行业表现较差。

本基金于6月25日成立,目前尚处于建仓期。截至三季度末,股票资产比例为86.3%。行业配置上,重点配置于医药生物、环保、餐饮旅游、交运设备、化工等行业。个股投资上,重点买入长期发展空间大、盈利模式稳固的优质成长股,同时也在传统行业中积极寻找低估值、基本面可能大幅改善的个股投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年三季度本基金的收益率为9.09%,比业绩比较基准高1.74百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,本基金的观点如下。第一,尽管三季度国内经济出现企稳回升迹象,但宏观经济的整体波动依然很难成为主流投资者的关注焦点。除了新政可能会推动经济结构转型的长期逻辑外,通胀率在四季度可能会持续位于3%以上,这会制约宏观经济继续回升的空间。第二,四季度的流动性环境会差于三季度。首先,在通胀率超过3%之后,央行可能会改变三季度偏宽松的做法。其次,四季度货币市场往往会面临数次流动性冲击。第三,四季度小盘股可能面临两方面的风险。一是因将于10月份公布的三季报业绩可能仍然比较差。二是今年以来中小盘股的牛市使得相当多投资者仅仅是基于趋势做出投资决策而忽视了对公司质地的审查,而四季度机构投资者将开始为明年布局,其投资决策方式可能会发生比较大的变化。综上所述,四季度A股市场的投资机会依然是结构性的,改革、创新以及消费行为变化可能会是主流投资者的关注焦点。而且面临投资环境的可能变化,投资者需要更审慎地去考察投资标的的质地。

本基金四季度重点关注以下方面的投资机会。第一,对于医药、环保、旅游等长期成长性行业,精选个股、长期持有。第二、国企改革可能会是十八届三中全会的重要议题之一,行业前景好、有资源优势、有改革动力的国企将面临重大转机。第三,互联网仍在深刻地改变人们的生活方式,智能电视、手机游戏、电子商务等领域诞生牛股的概率较大。第四,金融危机之后国际环境趋于紧张,政府会在引导需求由外部转入内部上有所作为,重点关注高端消费、民族品牌以及部分信息产品的投资机会。

§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	368,715,020.28	86.32
	其中:债券	368,715,020.28	86.32
	资产支持证券	-	-
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	62,809,675.56	14.70
6	其他资产	4,878,204.60	1.14
7	合计	435,402,900.44	101.86

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	159,998,000.00	10.45
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	152,763,106.75	9.98
8	其他	-	-
9	合计	312,761,106.75	20.43

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	110023	民生转债	700,000	74,067,000.00	4.84
2	110018	国电转债	536,400	58,392,504.00	3.81
3	112190	11亚迪02	300,000	30,000,000.00	1.96
3	124361	13京科技城债	300,000	30,000,000.00	1.96
4	122274	11航运02	200,000	20,000,000.00	1.31
4	124333	13铜城建	200,000	20,000,000.00	1.31
4	122267	13永泰债	200,000	20,000,000.00	1.31
5	127001	海直转债	105,149	12,374,565.21	0.81

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

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,935.18
2	应收证券清算款	180,580.56
3	应收股利	-
4	应收利息	6,104,585.13
5	应收申购款	135,423.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,433,524.62

5.9.4 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	110023	民生转债	74,067,000.00	4.84
2	110018	国电转债	58,392,504.00	3.81
3	127001	海直转债	12,374,565.21	0.81
4	110012	海运转债	3,533,250.00	0.23
5	128001	泰尔转债	1,790,844.10	0.12
6	110022	同仁转债	661,567.50	0.04

5.9.5 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	1,613,754,755.23	1,045,814,758.03
报告期期间基金总申购份额	4,764,817.34	21,634,745.95
减:报告期期间基金总赎回份额	458,919,071.66	719,464,036.56
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	1,159,600,500.91	347,985,467.42

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理的基金。

§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。

汇添富基金管理有限公司
2013年10月24日

汇添富美丽30股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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10月24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10月22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	汇添富美丽30股票
交易代码	000173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月25日
报告期末基金份额总额	391,221,112.96份
投资目标	本基金通过精选个股和集中投资,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金为股票型基金。股票投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险;