汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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

2.1 基金产品情况

基金简称	汇添富深证300ETF联接
交易代码	470068
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月28日
报告期末基金份额总额	77,545,448.15份
投资目标	通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以深证300交易型开放式指数证券投资基金作为其主要投资标的,并不参与目标ETF的管理。本基金主要以一级市场申购的方式投资于目标ETF,获取基金份额净值上涨带来的收益;在目标ETF基金份额二级市场交易流动性较好的情况下,也可以通过二级市场买卖目标ETF的基金份额。
业绩比较基准	深证300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159912
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月16日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年11月24日
基金管理人名称	汇添富基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,正常情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%,年跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	深证300指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§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)
1.本期已实现收益	-2,286,213.81
2.本期利润	11,651,008.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.1251
4.期末基金资产净值	77,853,881.53
5.期末基金份额净值	1.0040

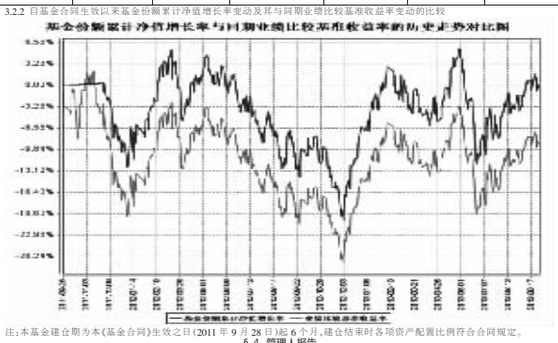
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	12.51%	1.28%	12.91%	1.31%	-0.40%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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(2011年9月28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		
吴振翔	汇添富上证综合指数、汇添富深证300ETF、汇添富深证300ETF联接、汇添富中证主要消费ETF、汇添富中证医药卫生ETF、汇添富中证能源ETF、汇添富中证金融地产ETF的基金经理、金融工程部总监助理。	2011年9月28日	-	7年	国籍:中国,学历:中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理,2008年3月加入汇添富基金管理有限公司任产品开发高级经理、数量投资高级分析师,现任金融工程部总监助理。2010年1月8日至2010年2月4日任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理助理,2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理,2011年9月16日至今任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2011年9月28日至今任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理,2013年8月23日至今任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2013年8月23日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2013年8月23日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2013年8月23日至今任中证金融地产交易型开放式指数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

回顾三季度,在"稳增长"背景下,投资和补库存等因素促使实体经济的景气程度有所改善,经济数据好于预期,整体增速好于上季度。同时,以上海自贸区为代表的一系列重大经济改革政策超越预期,凸显了中央转变经济增长方式的决心。经济数据的好转和深化改革的预期提振了市场信心。此外,海外发达经济体经济好转、美联储退出QE的时间表推后等因素也利好新兴市场,在这些因素的影响下,A股市场在三季度有所上涨。

本基金在报告期内遵循了指数基金的被动投资原则,保持了指数基金的本质属性,ETF和股票投资仓位在考察期内始终保持在92%-95%之间,在规负构建方面以深证300ETF为主要投资品,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内深证300指数上涨13.76%,本基金在报告期内累计收益率为12.51%,同期业绩比较基准收益率为12.91%,收益率落后业绩比较基准0.40%。收益率的差异因素主要来源于仓位不足95%、日常申购赎回等因素。本基金日均跟踪误差为0.0234%,这一跟踪误差水平远低于合同约定上限,在报告期达到了投资目标。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间,上季度促进经济改善的因素仍将延续,短期内经济向好的趋势不会改变,但中长期看,困扰经济进一步健康发展的结构性因素仍然存在,去杠杆和结构转型仍是未来一段时间经济面临的挑战,而这些挑战只能通过进一步的深化改革克服,即将召开的十八届三中全会很可能对未来较长时间的改革路径做出整体和全面的布置,市场对此有较高的预期,因此下一度市场的驱动因素很可能由经济数据的表现转为一系列改革措施的公布和执行情况,同时,地方债务审计结果和可能的IPO重启也将增加A股在未来一段时间的不确定性。外围市场,美国财政争议和QE退出节奏是影响下季度国际金融环境的重要因素,但整体上看发达经济体的复苏进程仍将延续,从而给A股创造较好的外部环境。

目前A股市场整体估值水平与历史和外围市场相比仍然较低,未来随着改革政策的进一步明确和落实,实体经济可能会步入新的发展阶段,估值水平有望回升,可能存在较好的投资机会。

作为被动投资的指数型基金,汇添富深证300ETF联接基金将严格遵守基金合同,继续坚持既定的指数化投资策略,积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差,我们也非常期望汇添富深证300ETF联接基金能继续与投资者一起分享中国经济的美好未来。

§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	1,283,559.00	1.64
	其中:股票	1,283,559.00	1.64
2	基金投资	72,816,547.13	92.99
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
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	4,043,206.07	5.16
7	其他资产	160,565.47	0.21
8	合计	78,303,877.67	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	14,655.00	0.02
B	采矿业	45,977.00	0.06
C	制造业	779,043.00	1.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,566.00	0.02
E	建筑业	20,378.00	0.03
F	批发和零售业	56,961.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	6,879.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,124.00	0.08
J	金融业	81,968.00	0.11
K	房地产业	111,054.00	0.14
L	租赁和商务服务业	27,050.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,300.00	0.04
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	23,364.00	0.03
S	综合	8,240.00	0.01
	合计	1,283,559.00	1.65

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	002292	奥飞动漫	2,900	81,664.00	0.10
2	000002	万科A	6,000	54,780.00	0.07
3	000651	格力电器	1,600	42,496.00	0.05
4	002024	苏宁云商	2,900	37,265.00	0.05
5	000001	平安银行	2,900	34,452.00	0.04
6	000776	广发证券	2,000	23,700.00	0.03
7	000538	云南白药	200	23,412.00	0.03
8	300027	华谊兄弟	300	23,364.00	0.03
9	000333	美的集团	500	21,620.00	0.03
10	000858	五粮液	1,200	21,600.00	0.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:本基金本报告期末未持有债券。
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
注:本基金本报告期末未持有债券。
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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	深300ETF	股票型	交易型开放式	汇添富基金管理有限公司	72,816,547.13	93.53

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:报告期末本基金无股指期货持仓。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期内未投资股指期货。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 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。
5.10.2 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。
5.10.3 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。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1
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。
5.11.2
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。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,453.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	777.19
5	应收申购款	146,334.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	160,565.47

5.11.4 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。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002292	奥飞动漫	81,664.00	0.10	临时停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	122,427,388.62
报告期期间基金总申购份额	6,352,781.34
减:报告期期间基金总赎回份额	51,234,721.81
报告期期末基金份额总额	77,545,448.15

§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深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件;
2、《汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》;
3、《汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
5.报告期内汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接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

汇添富季季红定期开放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	汇添富季季红定期开放债券(场内简称:添富季红)
基金主代码	164702
交易代码	164702
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月26日
报告期末基金份额总额	621,973,421.66份
投资目标	本基金主要投资于债券类固定收益品种,在严格管理投资风险的基础上,追求资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金80%以上的基金资产投资于债券资产,并在严格控制风险的基础上,通过对全球经济形势、中国经济发展(包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况)、证券市场估值水平等的研判,适度参与权益类资产配置,适度把握市场时机,力争为基金资产获取稳健回报。
业绩比较基准	银行三年期定期存款税后利率+1%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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

注:本基金自基金合同生效后,每封闭运作三年,集中开放一次申购和赎回。每三年(含三年)为一个封闭期。在此期间,投资者不能申购、赎回基金份额,但本基金可以在深圳证券交易所上市交易。每个封闭期到期日的次一工作日起(含该工作日),本基金将进入开放期。开放期不少于一周、不超过一个月,在此期间,投资者可以申购、赎回基金份额。开放期结束的次日(含该日)起,本基金进入下一个为期三年的封闭期。依此类推,循环运作。

§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)
1.本期已实现收益	11,450,413.67
2.本期利润	-1,384,470.96
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0022
4.期末基金资产净值	639,009,441.04
5.期末基金份额净值	1.027

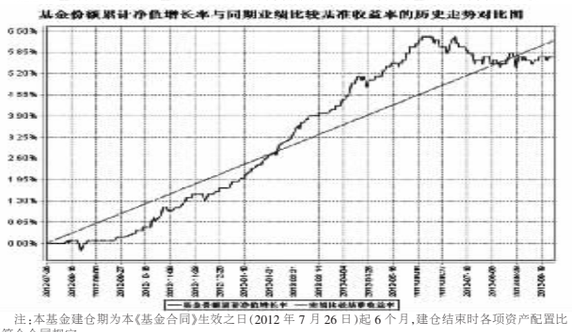
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	-0.29%	0.10%	1.26%	0.01%	-1.55%	0.09%

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(2012年7月26日)起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

本基金自基金合同生效后,每封闭运作三年,集中开放一次申购和赎回。每三年(含三年)为一个封闭期。在封闭期内,本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%(但在开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内,不受前述投资组合比例的限制),权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%。在开放期内,本基金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%。

§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型证券投资基金的基金经理;汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金的基金经理,汇添富收益快线货币市场基金的基金经理助理,固定收益投资副总监。	2012年7月26日	-	11年	国籍:中国,学历:华东师范大学金融学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。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有限公司任固定收益高级经理,现任固定收益投资副总监。2008年3月6日至今任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理,2009年1月21日至2011年6月21日任汇添富货币市场基金的基金经理,2011年1月26日至2013年2月7日任汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理,2012年7月26日至今任汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2012年12月31日至今任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理助理。

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

三季度欧美主要经济体继续维持良好的复苏态势,美国制造业PMI创出两年新高,房地产市场表现活跃,欧元区PMI也在两年来首次恢复到荣枯分水岭之上,与此同时,欧美等经济体通胀水平普遍维持低位,主要国家央行继续推行宽松的货币政策,全球金融市场风险偏好度稳步提升,股票、商品价格上涨,债券市场普遍下跌,美国10年期国债收益率最高回升到接近3%。三季度国内经济增速企稳回升,8月份工业增加值增速攀升至10.4%,为去年4月份以来最高,PMI各分项指数均有所改善,微观层面部分工业品需求转暖,价格降幅收窄,CPI窄幅波动,央行维持中性的货币政策,以公开市场微调为主,市场流动性状况比6月末有明显好转,但回购利率中枢与二季度相比明显抬升。

受资金面偏紧、经济企稳回升、债券供给量偏大等因素的影响,三季度债券市场出现较大幅度下跌,中债综合债券指数跌幅超过1%,各类债券收益率均出现较大幅度上行,10年期国债收益率一度接近4.2%,创2009年以来最高。债券收益率曲线非常平坦,信用利差保持低位。本基金三季度大部分时间采取了较为保守的投资策略,阶段性增持了短期债券,降低了信用债配置比例,杠杆维持在偏低的水平,较好的规避了债券市场的调整风险,9月份以后开始增持信用债品种,以提高组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四季度美国和欧元区经济继续维持复苏是大概率事件,美联储退出QE的节奏仍然是市场关注的焦点,9月份美联储例会意外宣布暂不削减QE规模,可能与美国就业市场改善情况不及预期有关,美国的量化宽松持续的时间可能会长于市场此前的预期。QE退出延缓有助于缓和国际资本回流美国的趋势,对新兴经济体的金融市场有正面影响。由于国内经济仍然处于转型期,多数中上游行业的产能消化需要较长时间,经济缺乏持续上升的内在动力,加上去年四季度基数偏高,经济回升的势头难以持续,四季度GDP增速可能重新出现回落。受食品价格上涨和基数效应影响,四季度CPI涨幅可能略有提高,但全年突破3%的可能性不大。货币政策将维持中性取向,四季度央行公开市场操作将以微调为主,保持流动性的合理供给。

四季度债券市场投资环境将好于三季度,随着经济回升放缓和供求关系改善,利率债存在一定的投资机会,信用利差虽然仍处于较低水平,但信用债绝对收益率已经比前期有明显提高,考虑到信用评级的密集下调已经告一段落,四季度信用事件将明显减少,信用债的配置价值明显提高。本管理人将采取更加积极的投资策略,立足绝对收益,择机加大对利率债和资质较好的信用债的配置力度,力争在控制风险的前提下为投资者创造持续稳定的收益。

§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	1,023,390,810.29	92.49
	其中:债券	1,003,379,254.13	90.68
	资产支持证券	20,011,556.16	1.81
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	41,487,929.43	3.75
6	其他资产	41,635,223.73	3.76
7	合计	1,106,513,963.45	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	88,279,000.00	13.81
	其中:政策性金融债	88,279,000.00	13.81
4	企业债券	915,100,254.13	143.21
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,003,379,254.13	157.02

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	112097	12家园债	513,380	50,927,296.00	7.97
2	130219	13国开19	500,000	48,765,000.00	7.63
3	122182	12九州通	320,000	32,000,000.00	5.01
4	1280323	12余姚水投债	300,000	30,762,000.00	4.81
5	122596	12沪城开	300,000	30,750,000.00	4.81

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

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	119030	澜沧江2	200,000	20,011,556.16	3.13

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	18,088.01
2	应收证券清算款	16,681,783.45
3	应收股利	-
4	应收利息	24,935,352.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,635,223.73

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:本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	621,973,430.09
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	8.43
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	621,973,421.66

注:转托管业务发生后导致场外份额不足最低保留份额5份的要求,引发强制赎回。

§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季季红定期开放债券型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富季季红定期开放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.报告期内汇添富季季红定期开放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

汇添富信用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	汇添富信用债债券
交易代码	470088
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月20日
报告期末基金份额总额	310,402,249.30份
投资目标	本基金主要投资于信用债券类固定收益品种,在严格管理投资风险、保持资产流动性的基础上,为基金份额持有人追求资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资于固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的80%,其中投资于信用债券的资产不低于基金固定收益类资产的80%;