汇添富理财28天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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	汇添富理财28天债券	
交易代码	471028	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年10月18日	
报告期末基金份额总额	176,044,701.07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	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148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,长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	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	汇添富理财28天债券A	汇添富理财28天债券B
下属两级基金的交易代码	471028	472028
报告期末下属两级基金的份额总额	139,716,771.97份	36,327,929.10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)	
	汇添富理财28天债券A	汇添富理财28天债券B
1.本期已实现收益	2,332,463.08	1,308,486.08
2.本期利润	2,332,463.08	1,308,486.08
3.期末基金资产净值	139,716,771.97	36,327,929.10

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28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	1.2345%	0.0020%	0.3403%	0.0000%	0.8942%	0.0020%

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。

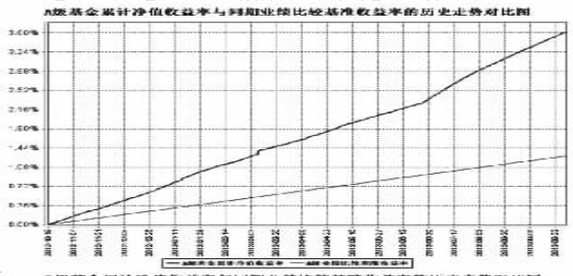
汇添富理财28天债券B

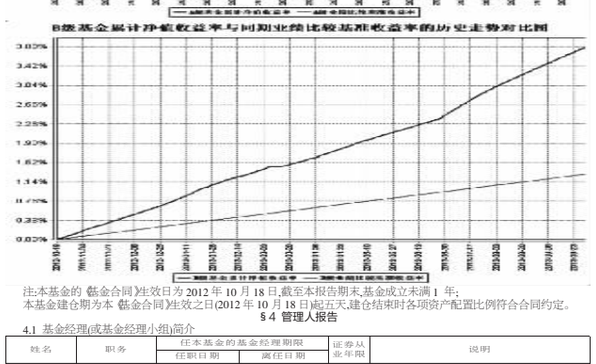
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.3074%	0.0020%	0.3403%	0.0000%	0.9671%	0.0020%

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10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10月18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		
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。	2012年10月18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

本期内宏观经济数据有所转暖,工业增加值和PMI等数据提振乐观预期,但同时认为数据需要继续观察的担忧也一直存在;美国陷入债务上限危机可能延后QE退出的时机,外汇占款一度好转;尽管九月份CPI上行,但通胀压力有限。经历6月份资金风波之后,央行公开市场操作体现出更大的灵活性,但是从几个时点刻意找平衡的细节来看,央行放短收长的基调并未放松,因此整个3季度内,仅8月份的资金面较为平稳,机构投资者买债时更显迟疑,债券市场处于小幅调整之中。三季度内,利率市场化又有新进展,加剧了金融机构负债成本上升的预期,带动资产配置结构出现新的变化,债券类配置动力不足。

3季度内,资金面时有反复但依然反映出央行基调未变,债券市场收益率先抬升后回落,银行同业存款相对于持有AA级短融仍具有小幅的配置优势。

本基金业绩得到一定改善,规模实现增长,各项指标正常,利用资金面的波动进一步优化了配置,为未来的业绩提供了支撑。基于持有人的结构分析,我们合理地应对了流动性的冲击,收益率较为稳定。

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1.2345%,B级净值收益率为1.3074%。

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,我们认为经济仍需继续观察,过往增长模式需要作出更多努力,放弃某些短期目标,才能逐步得到转变,QE退出只是延迟,九月的投资和出口数据也表明困难依然存在,而我们的消费贡献增长不多,企业利润率下降,对经济还难言乐观。考虑到历年来年末因素的影响,我们认为资金面的格局将与三季度相似,中性略为偏紧;受到待发行新债规模较大的影响,债市收益率维持小幅震荡格局,后期可能趋缓;在此格局下,短期内同业存款仍是配置的首选,但要注意增持信用债的有利时机,在控制好流动性风险的前提下,积极布局信用债。

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	59,854,278.73	33.86
	其中:债券	59,854,278.73	33.86
	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	114,609,297.76	64.84
4	其他资产	2,293,546.46	1.30
5	合计	176,757,122.95	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	3.54
	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	66
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	123
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36

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148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	53.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	5.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	11.36	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	16.95	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.60	-
5	180天(含)-397天(含)	11.37	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.10	-

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	19,837,757.83	11.27
	其中:政策性金融债	19,837,757.83	11.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,016,520.90	22.73
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	59,854,278.73	34.00
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	9,861,855.92	5.60

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	041358036	13长信科技CP001	100,000	10,015,716.26	5.69
2	041351016	13通期光电CP001	100,000	10,000,526.58	5.68
3	041358024	13旭阳化工CP001	100,000	10,000,210.67	5.68
4	041270008	12川电缆CP001	100,000	10,000,067.39	5.68
5	130201	13国开01	100,000	9,975,901.91	5.67
6	120227	12国开27	100,000	9,861,855.92	5.60

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	0.10%
报告期内偏离度的最低值	-0.04%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.03%

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,086,446.46
4	应收申购款	207,100.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,293,546.46

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富理财28天债券A	汇添富理财28天债券B
报告期期初基金份额总额	43,457,748.46	93,247,424.55
报告期期间基金总申购份额	403,652,176.01	175,210,912.33
减:报告期期间基金总赎回份额	307,393,152.50	232,130,407.78
报告期期末基金份额总额	139,716,771.97	36,327,929.10

§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理财28天债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富理财28天债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富理财28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28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

汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金

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	294,491,835.39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
下属两级基金的交易代码	470021	471021
报告期末下属两级基金的份额总额	77,008,983.16份	217,482,852.23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	1,204,454.19	2,863,770.90
2.本期利润	1,204,454.19	2,863,770.90
3.期末基金资产净值	77,008,983.16	217,482,852.23

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	1.0924%	0.0020%	0.3403%	0.0000%	0.7521%	0.0020%

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	1.1668%	0.0020%	0.3403%	0.0000%	0.8265%	0.0020%

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2013年1月24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		
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1月24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

本期内宏观经济数据有所转暖,工业增加值和PMI等数据提振乐观预期,但同时认为数据需要继续观察的担忧也一直存在;美国陷入债务上限危机可能延后QE退出的时机,外汇占款一度好转;尽管九月份CPI上行,但通胀压力有限。经历6月份资金风波之后,央行公开市场操作体现出更大的灵活性,但是从几个时点刻意找平衡的细节来看,央行放短收长的基调并未放松,因此整个3季度内,仅8月份的资金面较为平稳,机构投资者买债时更显迟疑,债券市场处于小幅调整之中。三季度内,利率市场化又有新进展,加剧了金融机构负债成本上升的预期,带动资产配置结构出现新的变化,债券类配置动力不足。

3季度内,资金面时有反复但依然反映出央行基调未变,债券市场收益率先抬升后回落,银行同业存款相对于持有AA级短融仍具有小幅的配置优势。

本基金业绩得到一定改善,规模实现增长,各项指标正常,利用资金面的波动进一步优化了配置,为未来的业绩提供了支撑。基于持有人的结构分析,我们合理地应对了流动性的冲击,收益率较为稳定。

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1.0924%,B级净值收益率为1.1668%。

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,我们认为经济仍需继续观察,过往增长模式需要作出更多努力,放弃某些短期目标,才能逐步得到转变,QE退出只是延迟,九月的投资和出口数据也表明困难依然存在,而我们的消费贡献增长不多,企业利润率下降,对经济还难言乐观。考虑到历年来年末因素的影响,我们认为资金面的格局将与三季度相似,中性略为偏紧;受到待发行新债规模较大的影响,债市收益率维持小幅震荡格局,后期可能趋缓;在此格局下,短期内同业存款仍是配置的首选,但要注意增持信用债的有利时机,在控制好流动性风险的前提下,积极布局信用债。

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	109,686,039.51	37.15
	其中:债券	109,686,039.51	37.15
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,000,000.00	1.35
	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	176,605,601.20	59.82
4	其他资产	4,936,174.75	1.67
5	合计	295,227,815.46	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	5.23
	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	145
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36

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	38.14	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	3.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	23.77	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	33.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	13.45	-
5	180天(含)-397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.16	-

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	39,620,711.49	13.45
	其中:政策性金融债	39,620,711.49	13.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,065,328.02	23.79
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	109,686,039.51	37.25
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	39,620,711.49	13.45

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	400,000	39,620,711.49	13.45
2	041360008	13津太钢CP001	200,000	20,019,258.33	6.80
3	041353005	13陕龙电气CP001	100,000	10,018,742.37	3.40
4	041267003	12辽宏塑CP002	100,000	10,013,429.71	3.40
5	041371001	13华邦CP001	100,000	10,006,222.60	3.40
6	041364005	13科伦CP001	100,000	10,004,433.85	3.40
7	041358018	13久立CP001	100,000	10,003,241.16	3.40

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	0.12%
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	0.06%

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天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况如下。本次超标已于2013年7月4日调整完毕。

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2013年7月1日	20.79	基金份额被赎回	10个交易日
2	2013年7月2日	20.82	基金份额被赎回	10个交易日
3	2013年7月3日	20.81	基金份额被赎回	10个交易日

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	-
2	应收证券清算款	1,704,275.00
3	应收利息	2,506,429.75
4	应收申购款	725,470.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,936,174.75

§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	154,705,254.28	86,375,541.64
报告期期间基金总申购份额	48,823,809.50	277,383,629.21
减:报告期期间基金总赎回份额	126,520,080.62	146,276,318.62
报告期期末基金份额总额	77,008,983.16	217,482,852.23

§7 基金管理人运用固有资