汇添富理财30天债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

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:2014年7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2014年7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2014年4月1日起至6月30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	1,132,023,580.12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,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	
下属两级基金的基金简称	汇添富理财30天债券A	汇添富理财30天债券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	1,037,407,850.51份	94,615,729.61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(2014年4月1日 - 2014年6月30日)	
	汇添富理财30天债券A	汇添富理财30天债券B
1. 本期已实现收益	12,730,441.19	2,892,106.27
2.本期利润	12,730,441.19	2,892,106.27
3.期末基金资产净值	1,037,407,850.51	94,615,729.61

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	1.0867%	0.0041%	0.3366%	0.0000%	0.7501%	0.0041%

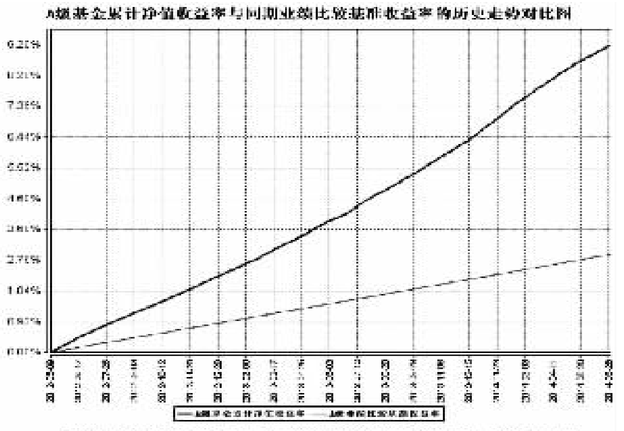
注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

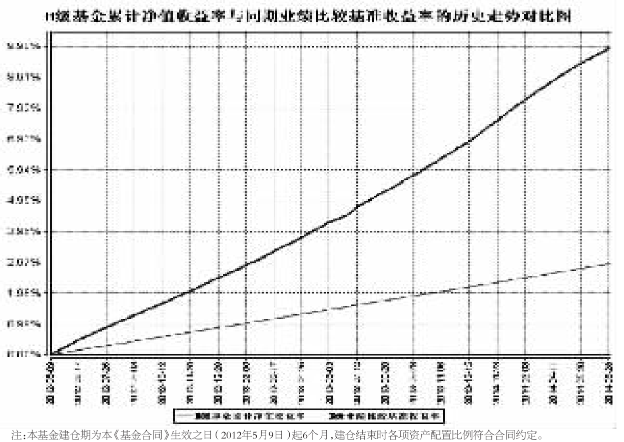
汇添富理财30天债券B

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	1.1596%	0.0041%	0.3366%	0.0000%	0.8230%	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		
汤丛珊	汇添富货币基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金、汇添富和聚宝货币基金的基金经理。	2014年1月21日	-	6年	国籍:中国,学历:上海财经大学管理学硕士。相关业务资格:基金从业资格。从业经历:2008年5月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任固定收益交易员、固定收益交易主管。2013年7月31日至今任汇添富货币基金的基金经理,2013年12月13日至今任汇添富全额宝货币基金的基金经理。2014年1月21日至今任汇添富理财30天债券、理财60天债券基金的基金经理,2014年5月28日至今任汇添富和聚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%的交易次数为3次,其中2次是由于对冲专户采取指数化策略投资导致,1次是由于投资流动性的需求导致。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

2014年二季度以来市场整体流动性仍然较为宽裕,二季度债券和存款收益率维持下行的走势,再投资收益逐步降低。

本基金在报告期适当增加了的组合剩余期限,精选优质短融和高息存款提高组合收益率,适当提高了优质短融的配置比例,合理安排存款到期日,提高组合整体流动性。通过这些前瞻性的操作,本基金有效应对了组合的规模变化,确保了组合的流动性和和合法合规运作,并锁定了一部分较高收益的同业存款和短期债券获取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

二季度本基金A级净值收益率为1.0867%,B级净值收益率为1.1596%。

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2014年下半年,政策基调仍然是稳增长和调结构并举,资金面不太会出现过紧的状况,存款对短融的相对优势上半年是逐渐减弱的,债券的配置对组合收益的贡献度将提升。短融方面,由于外围信托产品已出现多起大额的风险事件,下个季度要更加注重信用风险的防范和由信用风险衍生的资金面压力和流动性风险,在严防信用风险的前提下,择机加大短融的配置比例。

有鉴于此,下个季度,本基金将在密切跟踪基本面、政策面和资金面前提下,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,保持组合的较高流动性和安全性,积极把握市场结构性机会,通过在合适的时点锁定高收益的存款和灵活控制短融仓位博取资本利得收入为投资者创造更多额外收益。

§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	478,690,337.84	40.88
	其中:债券	478,690,337.84	40.88
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	55,000,000.00	4.70
	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	626,360,395.25	53.49
4	其他资产	10,989,794.56	0.94
5	合计	1,171,040,527.65	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	0.88	
	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	35,909,862.04	3.17
	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	103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	62

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	47.73	3.17
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	12.46	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	0.87	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.87	-
4	90天(含)-180天	12.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	6.96	-
5	180天(含)-397天(含)	29.14	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	102.48	3.17

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	168,543,566.39	14.89
	其中:政策性金融债	168,543,566.39	14.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	310,146,771.45	27.40
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	478,690,337.84	42.29
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	88,685,917.43	7.83

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	120227	12国开27	800,000	78,804,281.59	6.96
2	041358076	13魏桥CP002	500,000	50,097,919.41	4.43
3	041453047	14武钢CP001	500,000	50,001,470.20	4.42
4	130405	13农发05	400,000	39,813,985.80	3.52
5	140207	14国开07	300,000	30,051,613.99	2.65
6	041456010	14滨建投CP001	300,000	30,003,166.39	2.65
7	041464021	14澄星CP002	300,000	30,001,055.83	2.65
8	041456008	14穗地铁CP001	300,000	30,000,874.59	2.65
9	041453007	14苏交通CP001	300,000	30,000,262.69	2.65
10	041351036	13康美CP001	200,000	20,035,243.59	1.77

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	0.2407%
报告期内偏离度的最低值	0.1129%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1844%

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	9,520,394.56
4	应收申购款	1,469,400.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	10,989,794.56

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富理财30天债券A	汇添富理财30天债券B
报告期期初基金份额总额	1,152,984,372.85	487,783,870.43
报告期期间基金总申购份额	502,008,077.29	155,406,026.08
减:报告期期间基金总赎回份额	617,584,599.63	548,574,166.90
报告期期末基金份额总额	1,037,407,850.51	94,615,729.61

§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。

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
2014年7月19日

汇添富理财60天债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

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:2014年7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2014年7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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富理财60天债券	
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	770,467,582.38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	612,702,008.22份	157,765,574.16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(2014年4月1日 - 2014年6月30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	6,948,520.33	1,631,043.31
2.本期利润	6,948,520.33	1,631,043.31
3.期末基金资产净值	612,702,008.22	157,765,574.16

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	1.1910%	0.0072%	0.3366%	0.0000%	0.8544%	0.0072%

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。

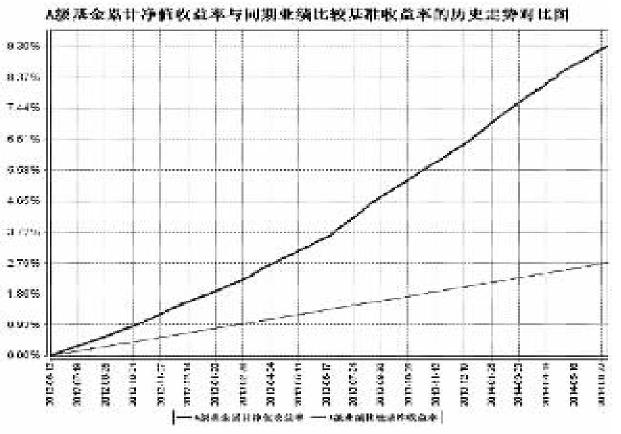
汇添富理财60天债券B

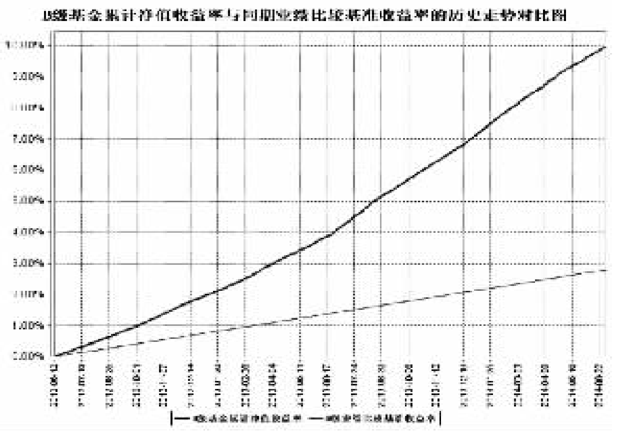
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.2636%	0.0072%	0.3366%	0.0000%	0.9270%	0.0072%

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		
汤丛珊	汇添富货币基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金、汇添富和聚宝货币基金的基金经理。	2014年1月21日	-	6年	国籍:中国,学历:上海财经大学管理学硕士。相关业务资格:基金从业资格。从业经历:2008年5月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任固定收益交易员、固定收益交易主管。2013年7月31日至今任汇添富货币基金的基金经理,2013年12月13日至今任汇添富全额宝货币基金的基金经理,2014年1月21日至今任汇添富理财30天债券、理财60天债券基金的基金经理,2014年5月28日至今任汇添富和聚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%的交易次数为3次,其中2次是由于对冲专户采取指数化策略投资导致,1次是由于投资流动性的需求导致。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

2014年二季度以来市场整体流动性仍然较为宽裕,二季度债券和存款收益率维持下行的走势,再投资收益逐步降低。

本基金在报告期适当增加了的组合剩余期限,精选优质短融和高息存款提高组合收益率,适当提高了优质短融的配置比例,合理安排存款到期日,提高组合整体流动性。通过这些前瞻性的操作,本基金有效应对了组合的规模变化,确保了组合的流动性和和合法合规运作,并锁定了一部分较高收益的同业存款和短期债券获取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

二季度本基金A级净值收益率为1.1910%,B级净值收益率为1.2636%。

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2014年下半年,政策基调仍然是稳增长和调结构并举,资金面不太会出现过紧的状况,存款对短融的相对优势上半年是逐渐减弱的,债券的配置对组合收益的贡献度将提升。短融方面,由于外围信托产品已出现多起大额的风险事件,下个季度要更加注重信用风险的防范和由信用风险衍生的资金面压力和流动性风险,在严防信用风险的前提下,择机加大短融的配置比例。

有鉴于此,下个季度,本基金将在密切跟踪基本面、政策面和资金面前提下,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,保持组合的较高流动性和安全性,积极把握市场结构性机会,通过在合适的时点锁定高收益的存款和灵活控制短融仓位博取资本利得收入为投资者创造更多额外收益。

§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	319,679,878.52	40.72
	其中:债券	319,679,878.52	40.72
	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	456,530,519.21	58.15
4	其他资产	8,830,371.30	1.12
5	合计	785,040,769.03	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	0.31	
	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	10,924,874.54	1.42
	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	106
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	130
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	95

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	43.87	1.42
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.83	-
2	30天(含)-60天	10.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	8.70	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	10.39	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	27.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.75	1.42

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	69,538,749.32	9.03
	其中:政策性金融债	69,538,749.32	9.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	250,141,129.20	32.47
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	319,679,878.52	41.49
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	29,485,321.06	3.83

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	041453047	14武钢CP001	300,000	30,000,930.96	3.89
2	120233	12国开33	300,000	29,485,321.06	3.83
3	041356039	13陕交建CP001	200,000	20,091,873.55	2.61
4	041456008	14穗地铁CP001	200,000	20,044,509.79	2.60
5	140207	14国开07	200,000	20,032,471.72	2.60
6	041460056	14广田CP002	200,000	20,002,009.42	2.60
7	041360069	13合工投CP001	200,000	20,000,264.77	2.60
8	041456007	14奇瑞CP001	200,000	20,000,105.93	2.60
9	041361046	13瑞水泥CP004	200,000	20,000,045.81	2.60
10	041365011	13海吉星CP002	200,000	19,993,322.18	2.59

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	21
报告期内偏离度的最高值	0.2976%
报告期内偏离度的最低值	0.2151%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2462%

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	234.94
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	8,271,086.36
4	应收申购款	559,050.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	8,830,371.30

§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
报告期期初基金份额总额	542,286,211.12	87,290,487.55
报告期期间基金总申购份额	314,345,386.51	90,818,921.63
减:报告期期间基金总赎回份额	243,929,589.41	20,343,835.02
报告期期末基金份额总额	612,702,008.22	157,765,574.16

§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。

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
2014年7月19日

汇添富理财7天债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

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:2014年7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2014年7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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富理财7天债券	
交易代码	471007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年5月29日	
报告期末基金份额总额	853,295,429.97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127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	
下属两级基金的基金简称	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B
下属两级基金的交易代码	471007	472007
报告期末下属两级基金的份额总额	632,231,653.34份	221,063,776.63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(2014年4月1日 - 2014年6月30日)	
	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B
1. 本期已实现收益	9,044,223.91	3,097,749.84
2.本期利润	9,044,223.91	3,097,749.84
3.期末基金资产净值	632,231,653.34	221,063,776.63

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7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	1.0624%	0.0065%	0.3366%	0.0000%	0.7258%	0.0065%

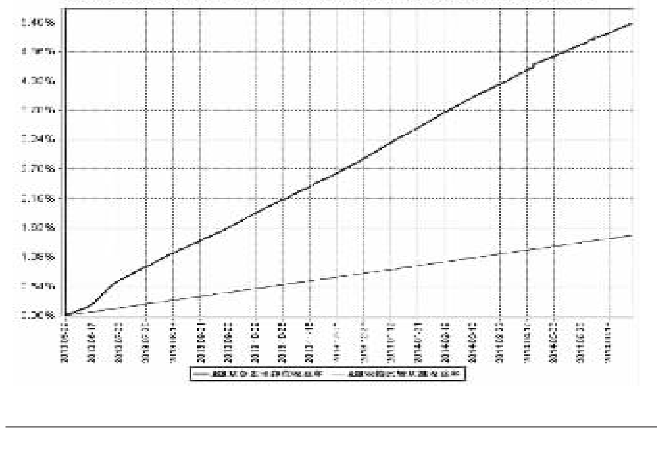
注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

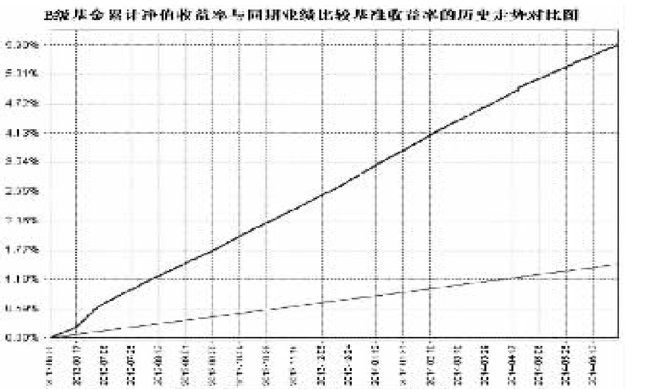
汇添富理财7天债券B

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	1.1724%	0.0065%	0.3366%	0.0000%	0.8358%	0.0065%

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5月29日,本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013年5月29日)起5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14天的基金经理助理,汇添富理财28天、理财21天、理财7天、汇添富多元收益、可转换债券、实业债债券、现金宝货币、双利增强债券的基金经理,固定收益投资副总监。	2013年5月29日	-	13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,曾任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,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%的交易次数为3次,其中2次是由于对冲专户采取指数化策略投资导致,1次是由于投资流动性的需求导致。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

二季度全球经济相对平稳,美国经济继续维持缓慢复苏的态势,失业率持续下降,就业情况好转;欧洲央行进一步降息和实施新一轮的LTRO,防止通缩风险。国内经济来看,二季度PMI呈现反弹态势但动能趋弱,地产销售依然低迷,房价跌幅扩大,投资回落均为拉低低经济增速的原因;物价方面,食品价格相对企稳,通胀短期无忧。经济的持续走弱导致货币政策在二季度有明显的放松,表现在没有续发央票、公开市场操作更为灵活、定向降准,并尽量熨平资金面季节性波动。

受到货币政策持续宽松的影响,二季度债券市场收益率下行显著,短期债券始终保持活跃,1年期金融债、短融收益率均下降超过30bp,由于流动性宽裕,银行存款利率下降速度较快。尽管在6月底受到R007维持在3.6%-4.0%的高位,但远低于去年二季度的水平,因此短期债券收益率仅受到小幅冲击。本基金二季度加大了对债券的配置比例,降低了银行存款配置比例,较好的把握了二季度短期债券的上涨机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

二季度本基金A级净值收益率为1.0624%,B级净值收益率为1.1724%。

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2014年三季度,社会融资成本仍较高,企业盈利并未改善。在经济下行压力未消、通胀仍处低位的大背景下,央行货币政策难紧。从上半年执行情况看,货币政策已经从过去的总量调节向结构性调控转变,预计货币利率仍会维持较低水平,7天回购均值有望在3.0-3.5%区间内。另一方面,预计债券供给可能仍处于高位,对收益率的进一步快速下行造成压力。需要关注中证登调整质押式回购债券准入规则等,也可能对低评级信用债造成打压,信用债市场将进一步分化。

我们将综合分析本基金的份额变动,做好债券与存款之间的配置。在保持一定仓位的高流动性同业存款,做好期限匹配管理的同时,择机把握高等级短融的波动机会,提高组合的投资收益。

§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	398,945,762.99	43.34
	其中:债券	398,945,762.99	43.34
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	50,000,195.00	5.43
	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	457,665,744.30	49.72
4	其他资产	13,880,846.41	1.51
5	合计	920,492,548.70	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	2.94	
	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	65,939,767.03	7.73
	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	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	67
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	41

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127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	53.63	7.73
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	8.12	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.76	-
3	60天(含)-90天	26.87	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	9.29	-
4	90天(含)-180天	9.42	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	8.20	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.24	7.73

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	188,348,931.27	22.07
	其中:政策性金融债	188,348,931.27	22.07
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	210,596,831.72	24.68
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	398,945,762.99	46.75
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	128,405,802.38	15.05

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	130236	13国开36	600,000	59,943,128.89	7.02
2	090205	09国开05	600,000	59,502,254.41	6.97
3	130212	13国开12	500,000	49,123,305.43	5.76
4	011337008	13中建材SCP008	300,000	29,997,569.04	3.52
5	041362036	13峨胜CP001	200,000	20,208,272.36	2.37
6	041354048	13万达CP003	200,000	20,173,839.51	2.36
7	041364040	13澄星CP003	200,000	20,150,297.18	2.36
8	041456007	14奇瑞CP001	200,000	20,001,712.31	2.34
9	041460022	14川铁投CP001	200,000	20,001,709.77	2.34
10	041451010	14浙物产CP001	200,000	20,000,549.22	2.34

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	40
报告期内偏离度的最高值	0.3914%
报告期内偏离度的最低值	0.1718%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2702%

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	9,961,912.41
4	应收申购款	3,918,934.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	13,880,846.41

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富理财7天债券A	汇添富理财7天债券B
报告期期初基金份额总额	878,141,760.94	245,365,650.00
报告期期间基金总申购份额	1,025,599,323.74	745,632,754.37
减:报告期期间基金总赎回份额	1,271,509,431.34	769,934,627.74
报告期期末基金份额总额	632,231,653.34	221,063,776.63

§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7天债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富理财7天债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富理财7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7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
2014年7月19日