汇添富年年利定期开放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	汇添富年年利定期开放债券	
交易代码	000221	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年9月6日	
报告期末基金份额总额	484,174,776.03份	
投资目标	在追求本金安全的基础上,本基金力争创造超越业绩比较基准的长期稳健收益。	
投资策略	本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,在每个受限开放期的前10个工作日和后10个工作日、自由开放期的前3个月和后3个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制,但在开放期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	银行一年期定期存款税后利率+1.2%	
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	汇添富年年利定期开放债券A	汇添富年年利定期开放债券C
下属两级基金的交易代码	000221	000222
报告期末下属两级基金的份额总额	335,664,200.31份	148,510,575.72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)	
	汇添富年年利定期开放债券A	汇添富年年利定期开放债券C
1.本期已实现收益	3,927,960.38	1,580,058.66
2.本期利润	7,310,943.83	3,072,746.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.0218	0.0207
4.期末基金资产净值	351,465,459.36	154,997,189.96
5.期末基金份额净值	1.047	1.044

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

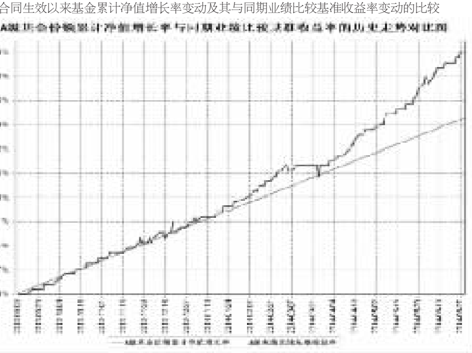
汇添富年年利定期开放债券A

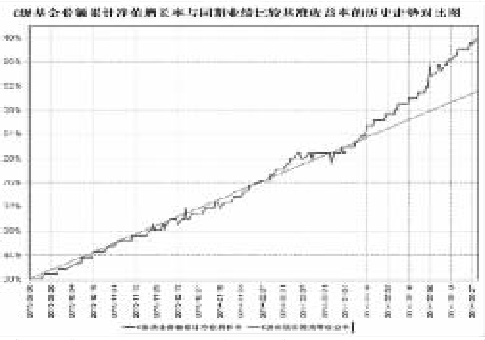
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.15%	0.05%	1.05%	0.01%	1.10%	0.04%

汇添富年年利定期开放债券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	2.05%	0.07%	1.05%	0.01%	1.00%	0.06%

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9 月6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9 月6 日)起6 个月,建仓期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		
陈加荣	汇添富理财14天债券基金的基金经理助理,汇添富双利债券基金、汇添富信用债债券基金、汇添富高息债债券基金、汇添富年年利定期开放债券基金的基金经理。	2013年2月7日	-	13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基金的基金经理。2012年3月加入汇添富基金管理股份有限公司任金融工程部高级经理,2012年7月10日至今任汇添富理财14天债券基金的基金经理助理,2012年12月21日至2014年1月21日任汇添富收益快线货币基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富双利债券基金、汇添富信用债债券基金的基金经理,2013年6月27日至今任汇添富高息债债券基金的基金经理,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

2季度政府在经济上维稳的紧迫性略有增强,央行继续维持相对宽松的资金供给。债券收益率曲线呈现"牛平"状,中长段的信用债、利率债利率均有不同程度的下行,利率债在127号文以及市场对经济刺激政策的预期下略有反复。本基金在考虑到基金开放剩余日的基础上适当拉长债券久期,杠杆增持流动性较好的信用债、利率债。信用债方面主要以信用风险相对较小的城投债为主,利率债久期相对较短。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年二季度本基金A级净值收益率为2.15%,C级净值收益率为2.05%,同期业绩比较基准收益率为1.05%。

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,政府在经济上维稳的态度比较明确,"微刺激"措施不断,国务院也派出了督查组加强"执行力"的检查,央行也比较配合,预计3季度市场流动性仍不会太紧,但由于经济结构性问题短期内难以解决,"微刺激"的小范围、低烈度特点以及去年3季度基期较高等因素,3季度经济是否能有所反弹尚需观察,经济刺激的见效与否关键还是要看4季度。但是,证券市场预期往往会有所提前。一般债券市场价值尚存,转债战略性机会渐显。本基金将基于定期开放的要求,稳健操作,承担有价值的风险,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	656,943,026.61	97.45
	其中:债券	646,940,758.11	95.97
	资产支持证券	10,002,268.50	1.48
3	贵金属投资	-	-
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	1,664,421.04	0.25
7	其他资产	15,526,382.95	2.30
8	合计	674,133,830.60	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	19,334,000.00	3.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,474,000.00	12.14
	其中:政策性金融债	61,474,000.00	12.14
4	企业债券	212,855,835.36	42.03
5	企业短期融资券	352,298,000.00	69.56
6	中期票据	-	-
7	可转债	978,922.75	0.19
8	其他	-	-
9	合计	646,940,758.11	127.74

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	041361041	13希望六和CP001	500,000	50,445,000.00	9.96
2	140208	14国开08	400,000	40,680,000.00	8.03
3	041464040	14粤海CP001	400,000	40,048,000.00	7.91
4	041454004	14苏交通CP002	300,000	30,318,000.00	5.99
5	041469020	14新兴CP001	300,000	30,114,000.00	5.95

5.6 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

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	123504	汇元一期A2	200,000	10,002,268.50	1.97

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五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,643.92
2	应收证券清算款	984,594.43
3	应收股利	-
4	应收利息	14,533,144.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,526,382.95

5.10.4 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。

5.10.5 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	汇添富年年利定期开放债券A	汇添富年年利定期开放债券C
报告期期初基金份额总额	335,664,200.31	148,510,575.72
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	-	-
报告期期末基金份额总额	335,664,200.31	148,510,575.72

§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年年利定期开放债券型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富年年利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、报告期内汇添富年年利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

汇添富全额宝货币市场基金

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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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	汇添富全额宝货币
交易代码	000397
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月13日
报告期末基金份额总额	4,511,724,574.93份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略,力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§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)
1. 本期已实现收益	54,511,994.72
2.本期利润	54,511,994.72
3.期末基金资产净值	4,511,724,574.93

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。

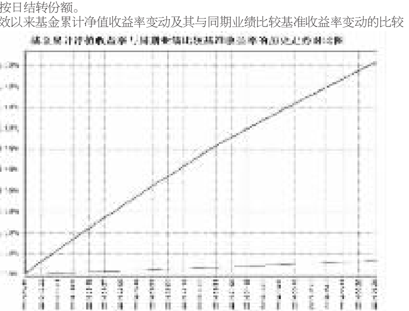
3.2 基金净值表现

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

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	1.1796%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	1.0923%	0.0008%

注:本基金收益分配按日结转份额。

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12月13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12月13日)起6个月,建仓期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		
陆文磊	汇添富增强收益债券基金、汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富互利分级债券基金、汇添富全额宝货币基金、汇添富收益快线货币基金的基金经理,固定收益投资总监。	2013年12月13日	-	12年	国籍:中国。学历:华东师范大学金融学博士。相关业务资格: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股份有限公司任固定收益高级经理,现任固定收益投资总监。2008年3月6日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理,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基金的基金经理,2012年12月31日至2014年1月20日任汇添富收益快线货币基金的基金经理助理,2013年11月6日至今任汇添富互利分级债券基金的基金经理,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日至今任汇添富收益快线货币基金的基金经理。
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。	2013年12月13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

二季度本基金净值收益率为1.1796%,业绩比较基准收益率为0.0873%。

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	920,469,044.24	20.12
	其中:债券	920,469,044.24	20.12
	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	3,615,016,806.96	79.03
4	其他资产	38,533,943.39	0.84
5	合计	4,574,019,794.59	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	0.61
	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	59,999,850.00	1.33
	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:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	94

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120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	33.14	1.33
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	12.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	26.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	6.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.66	-
5	180天(含)-397天(含)	22.84	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.53	1.33

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	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	278,857,965.66	6.18
	其中:政策性金融债	278,857,965.66	6.18
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	641,611,078.58	14.22
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	920,469,044.24	20.40
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	29,895,529.67	0.66

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	140319	14进出19	1,000,000	99,022,489.21	2.19
2	130236	13国开36	900,000	89,956,586.87	1.99
3	071427003	14海通证券CP003	800,000	80,022,617.09	1.77
4	041361044	13中普天CP001	500,000	50,447,369.93	1.12
5	041351051	13苏交通CP007	500,000	50,319,464.78	1.12
6	071420001	14长江证券CP001	500,000	50,037,260.49	1.11
7	130418	13农发18	500,000	49,982,988.14	1.11
8	041355032	13重汽CP002	300,000	30,129,276.21	0.67
9	041463007	14洛娃科技CP001	300,000	30,084,234.20	0.67
10	041461018	14沪电力CP001	300,000	30,055,039.09	0.67

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	0.0454%
报告期内偏离度的最低值	-0.0030%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0232%

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 本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

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	应收证券清算款	-
3	应收利息	38,533,943.39
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	38,533,943.39

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,631,352,807.81
报告期期间基金总申购份额	10,305,762,007.53
减:报告期期间基金总赎回份额	8,425,390,240.41
报告期期末基金份额总额	4,511,724,574.93

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2014年4月9日	60,000,000.00	60,000,000.00	-
2	红利再投	-	598,097.34	598,097.34	-
3	赎回	2014年6月25日	60,590,628.49	60,590,628.49	-
4	赎回	2014年6月26日	7,467.96	7,467.96	-
合计			0.89	0.89	

§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全额宝货币市场基金募集的文件;
2、《汇添富全额宝货币市场基金基金合同》;
3、《汇添富全额宝货币市场基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
5、报告期内汇添富全额宝货币市场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

汇添富上证综合指数证券投资基金

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	汇添富上证综合指数
交易代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月1日
报告期末基金份额总额	5,429,325,090.64份
投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于6%,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性,主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%且年化跟踪误差小于6%的投资目标。
业绩比较基准	上证综合指数收益率×95% + 银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。
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

§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)
1.本期已实现收益	20,688,036.84
2.本期利润	57,163,098.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.0110
4.期末基金资产净值	3,809,187,995.45
5.期末基金份额净值	0.702

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。

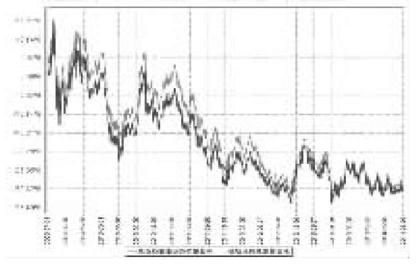
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.59%	0.76%	0.71%	0.73%	0.88%	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:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2009 年7月1日)起3个月,建仓期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、汇添富沪深300安中指数基金的基金经理,金融工程部总监助理。	2010年2月5日	-	8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股份有限公司,历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基金的基金经理,2011年9月16日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金的基金经理,2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF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ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金的基金经理,2013年11月6日至今任汇添富沪深300安中指数基金的基金经理。

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

回顾二季度,上证综指在经历短期反弹回落后窄幅震荡寻底,在前期市场底部已经徘徊数月,从基本面来看,经济复苏的不确定性是市场走势根本原因。二季度以来,房地产投资的持续下滑影响了经济增速,而"微刺激"政策持续出台则展现了决策层守住经济增长目标明确决心:央行、银监会等中央部委相继扩大了货币政策定向宽松的覆盖范围,部分地方政府也出台了多项稳增长措施。在相应政策的推动下,PMI数据回暖升至荣枯线上,显示实体经济的温和好转。资金面上,货币政策和信贷条件相对宽松,而新股发行重启等因素对流动性的影响也不容忽视。综合来看,二季度市场处于整体震荡收敛状态,而各种主题性投资机会则维持了市场的活跃程度。

报告期内, 本基金遵循指数基金的被动投资原则, 保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位报告期内基本保持在92%~95%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。本基金对抽样复制组合继续采取缓冲式调整,降低了冗余的交易量。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内上综指基准上涨0.71%,本基金在报告期内累计收益率为1.59%,收益率超越业绩比较基准0.88%。收益率的差异因素主要来源于期间成份股分红、日常申购赎回等因素。本基金日均跟踪误差为0.0743%,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

展望三季度,房地产行业的景气下行将持续影响经济增长,而坚守经济增速底线的思路将促使更多"微刺激"政策的出台,在这种环境下,整体经济复苏的势头有望进一步确认。从市场情况来看,近期的反弹走势已经积攒了部分人气,过分看空大盘是不可取的。我们对资金面的预判也支持这一观点:银监会调整商业银行存贷比已经展现一贯的定向宽松导向,整体市场的流动性水平或将在此导向下有所改善,三季度流动性大概率处于中性偏松的格局。外围市场方面,美国经济的全面复苏或将进入加速增长阶段,而欧洲央行的激进宽松或将推高资产价格,整体来看,外围市场的欣欣向荣有可能提振A股市场的投资者信心,但国内经济基本面在三季度能否回暖仍然是市场走势的决定因素。

目前市场整体估值较低,已经反应了较为悲观的预期,机构对周期性板块的配置比例很低,继续下跌的空间小。随着近期基本面的改善及市场情绪的好转,权益类资产的配置价值将逐渐提高。上证指数作为市场标杆,可能会有较好的表现。

作为被动投资的指数型基金,汇添富上证综合指数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。

§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	3,529,493,346.50	92.55
	其中:股票	3,529,493,346.50	92.55
2	固定收益投资	50,697,984.00	1.33
	其中:债券	50,697,984.00	1.33
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	231,159,967.21	6.06
7	其他资产	2,385,969.29	0.06
8	合计	3,813,737,267.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	16,636,531.43	0.44
B	采矿业	588,188,603.40	15.44
C	制造业	1,011,773,256.77	26.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	145,632,127.50	3.82
E	建筑业	103,199,761.52	2.71
F	批发和零售业	113,701,747.52	2.98
G	交通运输、仓储和邮政业	156,608,301.60	4.11
H	住宿和餐饮业	5,688,493.68	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	88,022,070.37	2.31
J	金融业	1,105,265,657.60	29.02
K	房地产业	121,546,696.65	3.19
L	租赁和商务服务业	14,124,153.71	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,695,279.94	0.25
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	32,428,644.62	0.85
S	综合	16,982,020.19	0.45
	合计	3,529,493,346.50	92.66

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601857	中国石油	38,987,720	293,967,408.80	7.72
2	601288	农业银行	76,761,480	193,438,929.60	5.08
3	601988	中国银行	55,977,394	142,742,354.70	3.75
4	600028	中国石化	21,973,701	115,801,404.27	3.04
5	600036	招商银行	10,270,931	105,174,333.44	2.76
6	601328	交通银行	20,774,950	80,606,806.00	2.12
7	601628	中国人寿	5,026,654	68,412,760.94	1.80
8	601166	兴业银行	6,767,910	67,882,137.30	1.78
9	600000	浦发银行	6,890,065	62,355,088.25	1.64
10	601088	中国神华	3,982,246	57,901,856.84	1.52

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

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	50,000,000.00	1.31
	其中:政策性金融债	50,000,000.00	1.31
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	697,984.00	0.02
8	其他	-	-
9	合计	50,697,984.00	1.33

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	130227	13国开27	500,000	50,000,000.00	1.31
2	110025	国金转债	6,080	697,984.00	0.02

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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、处罚的情形。

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	310,379.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,904,419.49
5	应收申购款	171,170.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,385,969.29

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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进行积极投资,不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	5,272,082,047.97
报告期期间基金总申购份额	336,162,370.90
减:报告期期间基金总赎回份额	178,919,328.23
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	5,429,325,090.64

§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上证综合指数证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》;
3、《汇添富上证综合指数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、报告期内汇添富上证综合指数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