汇添富全额宝货币市场基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31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:2015年1月22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2015年1月20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10月1日起至12月31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	6,517,417,515.64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10月1日 - 2014年12月31日）
1. 本期已实现收益	66,245,905.50
2.本期利润	66,245,905.50
3.期末基金资产净值	6,517,417,515.64

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。

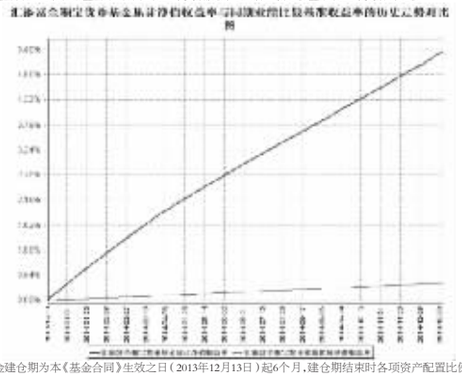
3.2 基金净值表现

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	1.1187%	0.0022%	0.0882%	0.0000%	1.0305%	0.0022%

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、汇添富快钱货币基金的基金经理。	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:曾任上海中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,2014年12月23日至今任汇添富收益快钱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建设,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

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1次,是由于投资流动性的需求导致。

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

四季度经济继续走弱,工业增加值增速持续维持在8%以下,固定资产投资增速降至近年来最低水平。企业去库存压力依然较大,微观层面发电量、大宗生产资料价格走势等指标同样显示经济增长动能不足。国际原油价格受到需求不振、供给增加和美元升值等多重不利因素的冲击出现崩盘走势,通胀压力进一步减轻,CPI涨幅维持在2%以下的低位运行。四季度财政和货币政策进一步放松,央行先后运用多种工具定向放松,并于11月份意外降息。受到经济疲弱和政策放松的刺激,四季度债券市场大幅上涨,中债综合财富指数涨幅达到2.58%,债券收益率大幅下降,收益率曲线中长端降幅大于短端,曲线较为平坦。12月份央行降息的利好被消化以后,债券收益率出现见底回升,市场出现一定幅度的调整。本基金四季度保持了较高的杠杆,维持较高的久期,继续超配了利率债,降息以后及时降低了组合久期,获取了一定的波段收益,同时对可转债进行较为积极的操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A级净值增长率为3.79%,C级净值增长率为3.75%。

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2015年一季度,国际市场不确定性依然存在,美国经济有望保持良好的运行态势,美联储货币政策正常化步伐不会改变,最快有望在二季度开始加息,美元汇率继续升值是大概率事件,资金从新兴市场回流美国可能会加剧新兴市场困境,其后续影响需要继续保持关注。国内经济仍面临较大下行压力,一季度经济能否有所企稳,主要取决于房地产市场能否持续转暖,同时,43号文出台以后,地方债务治理将进入攻坚阶段,地方政府投资能力将受到明显制约,稳增长将更多依赖于中央财政的政策力度。2014年四季度召开的中央经济工作会议明确提出积极财政政策要有力度,货币政策要更加注重松紧适度,可以预期2015年宏观调控政策的基调有望进一步趋于宽松,经济基本面对债券市场仍然具备较强支撑。债券市场目前没有系统性风险,但考虑到绝对收益率水平已经偏低,未来更加有赖于票息收益,另外收益率曲线的陡峭化是相对明确的交易性机会。本管理人将坚持价值投资的理念,重视绝对收益目标,积极调整组合结构,控制组合下行风险,力争为投资者创造持续稳定的收益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	1,880,131,549.19	28.83
	其中:债券	1,880,131,549.19	28.83
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	454,697,122.05	6.97
	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	4,101,953,818.77	62.91
4	其他资产	83,928,379.40	1.29
5	合计	6,520,710,869.41	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	1.93
	其中:买断式回购融资	0.02

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	111
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	97

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	26.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	9.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	26.35	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.45	-
4	90天(含)-180天	17.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天（含）	19.03	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		98.76	-

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	359,164,316.12	5.51
	其中:政策性金融债	359,164,316.12	5.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,520,967,233.07	23.34
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,880,131,549.19	28.85
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	29,279,932.02	0.45

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	140443	14农发43	1,000,000	99,955,025.53	1.53
2	140218	14国开18	1,000,000	99,912,353.36	1.53
3	041460084	14中金集CP001	500,000	50,248,468.34	0.77
4	041464036	14张资产CP001	500,000	50,172,718.83	0.77
5	140223	14国开23	500,000	49,998,651.05	0.77
6	071440006	14东吴证券CP006	500,000	49,988,865.61	0.77
7	041456058	14三安CP002	500,000	49,979,030.14	0.77
8	041455003	14金隅CP001	400,000	40,157,408.85	0.62
9	041469051	14中纺CP001	400,000	39,993,389.03	0.61
10	041455034	14金隅CP004	300,000	30,121,469.60	0.46

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	0.2157%
报告期内偏离度的最低值	-0.0698%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1119%

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	83,928,379.40
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	83,928,379.40

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	5,246,691,074.06
报告期期间基金总申购份额	7,846,482,394.98
减:报告期期间基金总赎回份额	6,575,755,953.40
报告期期末基金份额总额	6,517,417,515.64

注:总申购份额含红利再投份额。

§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
2015年1月22日

汇添富增强收益债券型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31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:2015年1月22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2015年1月20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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富增强收益债券	
交易代码	519078	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年3月6日	
报告期末基金份额总额	499,948,476.11份	
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,主要投资于债券等固定收益类品种和其他低风险品种,力求为基金份额持有人谋求持续稳定的投资收益。	
投资策略	类属资产配置由基金管理人根据宏观经济分析、债券基准收益率研究、不同类别债券利差水平研究,判断不同类别债券类属的相对投资价值,并确定不同债券类属在组合资产中的配置比例。	
业绩比较基准	中债总指数。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。	
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	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C
下属两级基金的交易代码	519078	470078
报告期末下属两级基金的份额总额	452,898,193.50份	47,050,282.61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10月1日 - 2014年12月31日）	
	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C
1.本期已实现收益	15,234,224.46	1,614,547.36
2.本期利润	23,471,073.45	2,411,001.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0431	0.0404
4.期末基金资产净值	521,388,807.86	53,298,018.47
5.期末基金份额净值	1.151	1.133

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

汇添富增强收益债券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	3.79%	0.17%	2.44%	0.22%	1.35%	-0.05%

汇添富增强收益债券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	3.75%	0.17%	2.44%	0.22%	1.31%	-0.05%

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:1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2008年3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。

2、本基金自2009年9月15日起增加C类收费模式,该类别基金的累计份额净值增长率和业绩比较基准收益率自2009年9月15日起计算。

§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、汇添富快钱货币基金的基金经理助理。	2008年3月6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:曾任上海中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。2014年12月23日至今任汇添富收益快钱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建设,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

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1次,是由于投资流动性的需求导致。

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

四季度经济继续走弱,工业增加值增速持续维持在8%以下,固定资产投资增速降至近年来最低水平。企业去库存压力依然较大,微观层面发电量、大宗生产资料价格走势等指标同样显示经济增长动能不足。国际原油价格受到需求不振、供给增加和美元升值等多重不利因素的冲击出现崩盘走势,通胀压力进一步减轻,CPI涨幅维持在2%以下的低位运行。四季度财政和货币政策进一步放松,央行先后运用多种工具定向放松,并于11月份意外降息。受到经济疲弱和政策放松的刺激,四季度债券市场大幅上涨,中债综合财富指数涨幅达到2.58%,债券收益率大幅下降,收益率曲线中长端降幅大于短端,曲线较为平坦。12月份央行降息的利好被消化以后,债券收益率出现见底回升,市场出现一定幅度的调整。本基金四季度保持了较高的杠杆,维持较高的久期,继续超配了利率债,降息以后及时降低了组合久期,获取了一定的波段收益,同时对可转债进行较为积极的操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A级净值增长率为3.79%,C级净值增长率为3.75%。

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2015年一季度,国际市场不确定性依然存在,美国经济有望保持良好的运行态势,美联储货币政策正常化步伐不会改变,最快有望在二季度开始加息,美元汇率继续升值是大概率事件,资金从新兴市场回流美国可能会加剧新兴市场困境,其后续影响需要继续保持关注。国内经济仍面临较大下行压力,一季度经济能否有所企稳,主要取决于房地产市场能否持续转暖,同时,43号文出台以后,地方债务治理将进入攻坚阶段,地方政府投资能力将受到明显制约,稳增长将更多依赖于中央财政的政策力度。2014年四季度召开的中央经济工作会议明确提出积极财政政策要有力度,货币政策要更加注重松紧适度,可以预期2015年宏观调控政策的基调有望进一步趋于宽松,经济基本面对债券市场仍然具备较强支撑。债券市场目前没有系统性风险,但考虑到绝对收益率水平已经偏低,未来更加有赖于票息收益,另外收益率曲线的陡峭化是相对明确的交易性机会。本管理人将坚持价值投资的理念,重视绝对收益目标,积极调整组合结构,控制组合下行风险,力争为投资者创造持续稳定的收益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	750,782,807.55	95.19
	其中:债券	740,725,807.55	93.92
	资产支持证券	10,057,000.00	1.28
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	9,631,764.08	1.22
7	其他资产	28,282,654.36	3.59
8	合计	788,697,225.99	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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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	163,617,000.00	28.47
	其中:政策性金融债	163,617,000.00	28.47
4	企业债券	512,595,998.09	89.20
5	企业短期融资券	29,973,000.00	5.22
6	中期票据	-	-
7	可转债	34,539,809.46	6.01
8	其他	0.00	0.00
9	合计	740,725,807.55	128.89

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	140440	14农发40	500,000	51,060,000.00	8.88
2	130228	13国开28	400,000	40,016,000.00	6.96
3	140210	14国开10	300,000	32,475,000.00	5.65
4	140429	14农发29	300,000	30,051,000.00	5.23
5	124534	14渝中债	200,000	21,300,000.00	3.71

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	1489014	14开元1A	100,000	10,057,000.00	1.75

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、处罚的情形。

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	69,483.96
2	应收证券清算款	29,903.81
3	应收股利	-
4	应收利息	18,080,068.21
5	应收申购款	10,103,198.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,282,654.36

5.10.4 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	110015	石化转债	13,492,000.00	2.35
2	113001	中行转债	5,480,650.00	0.95
3	110012	海运转债	3,426,505.60	0.60

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:本基金本报告期末未持有股票投资。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富增强收益债券A	汇添富增强收益债券C
报告期期初基金份额总额	467,420,648.04	62,576,445.92
报告期期间基金总申购份额	203,297,445.20	64,993,585.88
减:报告期期间基金总赎回份额	217,819,899.74	80,519,749.19
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	452,898,193.50	47,050,282.61

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本基金的基金管理人本报告期内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增强收益债券型证券投资基金募集的文件;
2、《汇添富增强收益债券型证券投资基金合同》;
3、《汇添富增强收益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、报告期内汇添富增强收益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
2015年1月22日

汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31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:2015年1月22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2015年1月20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10月1日起至12月31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	266,266,247.92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	154,598,430.33份	111,667,817.59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10月1日 - 2014年12月31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	2,892,165.73	1,959,175.64
2.本期利润	4,265,613.18	2,947,219.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0276	0.0264
4.期末基金资产净值	168,723,518.13	121,291,163.50
5.期末基金份额净值	1.091	1.086

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