# 汇添富外延增长主题股票型证券投资基金

## 2015 第一季度 报告

2015年3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4月21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4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2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富外延增长股票 |
| 交易代码 | 000925 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年12月8日 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,430,334,135.18份 |
| 投资目标 | 本基金采用自下而上的投资方法,以基本面分析为立足点,精选外延增长主题股票,重点挖掘外延式增长的投资机会,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金为股票型基金。投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险;个股精选策略用于挖掘通过并购重组活动实现企业外延式增长的上市公司。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×80%+中债综合指数×20% |
| 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预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 |
| 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 |

§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(2015年1月1日 - 2015年3月31日 ) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 201,167,347.90 |
| 2.本期利润 | 2,138,475,604.79 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.3962 |
| 4.期末基金资产净值 | 7,546,467,625.48 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.390 |

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 | 40.83% | 1.93% | 11.69% | 1.46% | 29.14% | 0.47% |

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

从具体运作角度分析,本基金在1季度处于建仓期,由于受到去年底风格资产急剧变化的影响,建仓计划难度空前巨大。1月份基金仓位较低,一直在选择资产配置和行业配置的方向。从1月底开始,本基金选择成长股作为突破口,重点配置与互联网相关的各种行业,选择其中的资产重组和收购标的,取得了比较好的收益率。本基金一直认为资本市场的投资方向很多,但是一定要选择代表未来的资产才能取得满意的超额收益。对新兴产业的选择是在慎重考虑的基础上做出的,并且对资产价格的适度波动也有充分的心理准备。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金取得收益率为40.83%,业绩比较基准表现为11.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金认为2季度乃至年底,中国经济增长的重心会持续下降到一个中等水平,不同产业之间的结构性变化会非常剧烈,宽松的财政政策和货币政策是大概率事件。基于这一判断,本基金认为股票市场的表现依然值得期待。在目前的指数位置,不可否认波动幅度会加大,但是资产价格依然可能普遍上涨。因此,我们认为适宜的投资策略是坚持自己擅长的成长股投资,在重组和并购两个领域深度挖掘个股的投资机会。

就具体行业而言,本基金依然看好互联网、新能源和环保、消费、医药等代表未来的行业,特别对创新商业模式或者技术创新的新业态和资产被上市公司收购或者参股的案例密切关注。资本市场是一个非常市场化的选择机制,被投资者看好代表未来的资产往往享受较高的估值。因此,本基金坚持成长占先,适度考虑估值和公司质地,对重组和并购中出现的新商业模式尤其关注,期待从中挖掘到超额收益。

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 | 7,004,454,176.55 | 89.67 |
| | 其中:股票 | 7,004,454,176.55 | 89.67 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | 495,530,080.76 | 6.34 |
| 7 | 其他资产 | 310,956,511.89 | 3.98 |
| 8 | 合计 | 7,810,940,769.20 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 390,475,944.57 | 5.17 |
| C | 制造业 | 1,118,510,327.78 | 14.82 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 125,406,005.40 | 1.66 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 83,983,254.48 | 1.11 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,917,488,184.37 | 65.16 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 38,777,401.74 | 0.51 |
| L | 租赁和商务服务业 | 80,141,701.26 | 1.06 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 61,879,056.00 | 0.82 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 62,244,672.00 | 0.82 |
| Q | 卫生和社会工作 | 42,633,868.80 | 0.56 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 82,913,760.15 | 1.10 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 7,004,454,176.55 | 92.82 |

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 | 300168 | 万达信息 | 5,265,560 | 431,354,675.20 | 5.72 |
| 2 | 600570 | 恒生电子 | 3,491,133 | 380,114,561.04 | 5.04 |
| 3 | 600446 | 金证股份 | 3,000,231 | 365,428,135.80 | 4.84 |
| 4 | 002153 | 石基信息 | 2,700,873 | 329,236,418.70 | 4.36 |
| 5 | 300378 | 鼎捷软件 | 3,379,829 | 285,764,541.95 | 3.79 |
| 6 | 300352 | 北信源 | 7,703,701 | 267,010,276.66 | 3.54 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 5,879,874 | 244,602,758.40 | 3.24 |
| 8 | 300166 | 东方国信 | 4,284,229 | 233,918,903.40 | 3.10 |
| 9 | 002363 | 隆基机械 | 6,999,200 | 225,724,200.00 | 2.99 |
| 10 | 600711 | 盛屯矿业 | 14,999,859 | 216,447,965.37 | 2.87 |

9.1 ……

# 深证300交易型开放式指数证券投资基金

## 2015 第一季度 报告

2015年3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4月21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4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2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富深证300ETF |
| 场内简称 | 深300ETF |
| 交易代码 | 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 52,748,991.00份 |
| 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。 |
| 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(2015年1月1日 - 2015年3月31日 ) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 13,467,429.93 |
| 2.本期利润 | 22,189,982.32 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.3532 |
| 4.期末基金资产净值 | 80,604,011.02 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.5281 |

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。

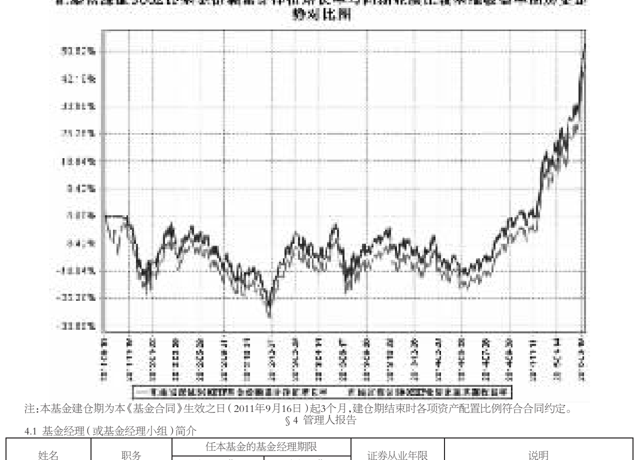
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 30.36% | 1.47% | 31.16% | 1.47% | -0.80% | 0.00% |

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



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 | 80,121,893.30 | 99.16 |
| | 其中:股票 | 80,121,893.30 | 99.16 |
| 2 | 固定收益投资 | 54,377.07 | 0.07 |
| | 其中:债券 | 54,377.07 | 0.07 |
| | 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 | 26,987.37 | 0.03 |
| 7 | 其他资产 | 600,058.66 | 0.74 |
| 8 | 合计 | 80,803,316.40 | 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 | 1,119,914.83 | 1.39 |
| B | 采矿业 | 1,930,103.37 | 2.39 |
| C | 制造业 | 43,980,329.16 | 54.56 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,340,813.16 | 1.66 |
| E | 建筑业 | 1,347,882.90 | 1.67 |
| F | 批发和零售业 | 2,997,719.44 | 3.72 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 143,092.82 | 0.18 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 8,746,642.95 | 10.85 |
| J | 金融业 | 7,998,640.57 | 9.92 |
| K | 房地产业 | 5,156,058.43 | 6.40 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,857,989.41 | 2.31 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,512,164.33 | 1.88 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 143,901.90 | 0.18 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,438,325.03 | 1.78 |
| S | 综合 | 408,315.00 | 0.51 |
| | 合计 | 80,121,893.30 | 99.40 |

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 | 000002 | 万 科A | 162,174 | 2,241,244.68 | 2.78 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 43,736 | 1,914,762.08 | 2.38 |
| 3 | 000001 | 平安银行 | 100,283 | 1,579,457.25 | 1.96 |
| 4 | 000776 | 广发证券 | 55,316 | 1,543,316.40 | 1.91 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 39,171 | 1,290,684.45 | 1.60 |
| 6 | 000166 | 申万宏源 | 65,761 | 1,135,034.86 | 1.41 |
| 7 | 000783 | 长江证券 | 66,043 | 1,048,762.84 | 1.30 |
| 8 | 000625 | 长安汽车 | 51,363 | 1,042,155.27 | 1.29 |
| 9 | 002024 | 苏宁云商 | 77,402 | 1,011,644.14 | 1.26 |
| 10 | 000100 | TCL 集团 | 145,015 | 855,588.50 | 1.06 |

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

……人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。详情请见2015年4月4日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准深证300交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;
2、《深证300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
3、《深证300交易型开放式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、报告期内深证300交易型开放式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。

9.2 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

9.3 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4月21日

# 汇添富收益快钱货币市场基金

## 2015 第一季度 报告

2015年3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4月21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4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2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 汇添富快钱货币 | |
| 场内简称 | 添富快钱 | |
| 交易代码 | 159005 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2014年12月23日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 3,915,203.00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 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 添富快钱A | 添富快钱B |
| 下属分级基金的交易代码 | 159005 | 159006 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,575,967.00份 | 1,339,236.00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(2015年1月1日 - 2015年3月31日 ) | |
|---|---|---|
| | 添富快钱A | 添富快钱B |
| 1. 本期已实现收益 | 1,582,998.60 | 2,880,164.62 |
| 2.本期利润 | 1,582,998.60 | 2,880,164.62 |
| 3.期末基金资产净值 | 257,596,700.00 | 133,923,600.00 |

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

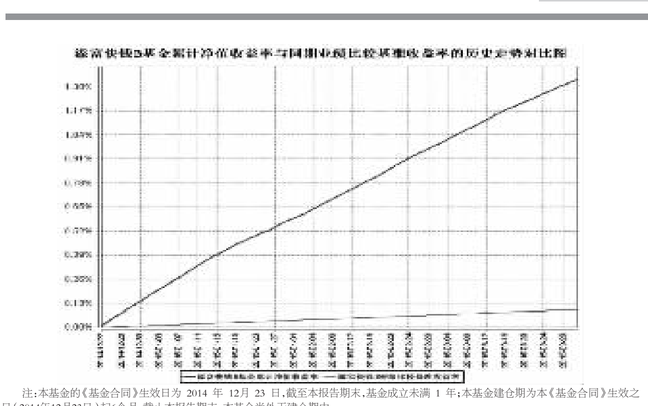
添富快钱A

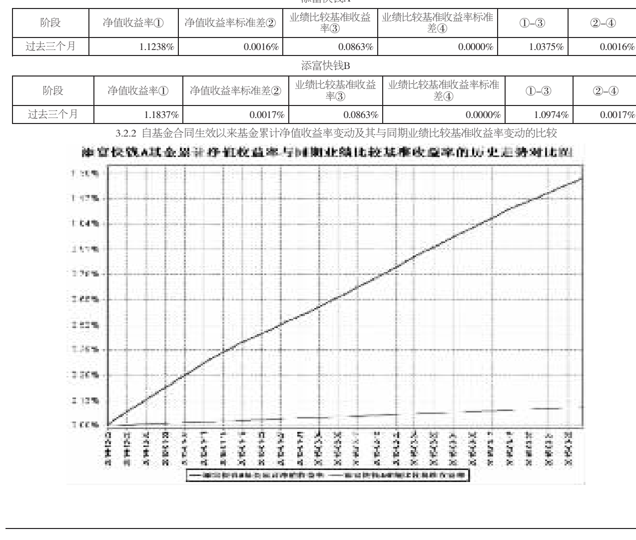
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.1238% | 0.0016% | 0.0863% | 0.0000% | 1.0375% | 0.0016% |

添富快钱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 | 1.1837% | 0.0017% | 0.0863% | 0.0000% | 1.0974% | 0.0017% |

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





……本回到2015年初水平。

操作上,本基金成立时间较短,以稳健操作为准。在一季度密切关注IPO的发行节奏,管理团队及时跟踪持有人申赎安排,以流动性管理为首要任务,采取相对谨慎策略,进一步降低评级底且流动性较差的短融配置比例,并配合较短久期的回购以及存款应对资金面冲击,与此同时小幅提升高评级短融的仓位,在降低组合的风险的同时为持有人获取稳定回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年一季度本基金 A 级净值收益率为1.1238%,B 级净值收益率为 1.1837%。

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2季度,外部环境相对良好,美国经济复苏趋势不变,欧元区经济有企稳迹象。分析国内情况,二季度GDP增速大概率可能较一季度继续小幅下行,货币政策稳健趋势不变,央行将更多引导资金利率下行,数量宽松措施目的是跟随利率市场化进程调整"中性适度"所对应的流动性水平,修正前期偏紧的资金面。财政政策将继续宽松。因此我们对二季度固定收益市场维持中性,信用债分化将进一步加剧。

我们将兼顾流动性和收益性目标,对组合资产进行积极调整,力争在控制风险的前提下为投资者创造持续稳定的收益。密切关注IPO的发行节奏,在做好流动性管理的同时,择机把握中高等级短期融资券以及短期利率债的交易型机会,提高组合收益。

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 | 59,981,504.43 | 15.31 |
| | 其中:债券 | 59,981,504.43 | 15.31 |
| | 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 | 331,278,684.41 | 84.54 |
| 4 | 其他资产 | 617,375.40 | 0.16 |
| 5 | 合计 | 391,877,564.24 | 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 | 0.53 | |
| | 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: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 | 68 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 68 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 21 |

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 | 84.61 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)-60天 | - | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | - | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | - | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 15.32 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 99.93 | - |

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 | 19,991,283.11 | 5.11 |
| | 其中:政策性金融债 | 19,991,283.11 | 5.11 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 39,990,221.32 | 10.21 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 59,981,504.43 | 15.32 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | - | - |

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 | 011595001 | 15中化工SCP001 | 200,000 | 19,994,927.46 | 5.11 |
| 2 | 041553020 | 15谷神CP001 | 100,000 | 10,000,608.89 | 2.55 |
| 3 | 140230 | 14国开30 | 100,000 | 9,998,544.15 | 2.55 |
| 4 | 011537002 | 15中建材SCP002 | 100,000 | 9,994,684.97 | 2.55 |
| 5 | 150403 | 15农发03 | 100,000 | 9,992,738.96 | 2.55 |

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 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0082% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0126% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0034% |

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,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

本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 | 546,660.90 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | 70,714.50 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 617,375.40 |

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 添富快钱A | 添富快钱B |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 439,200.00 | 2,090,188.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 47,178,647.00 | 14,318,560.00 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 45,041,880.00 | 15,069,512.00 |
| 报告期期末基金份额总额 | 2,575,967.00 | 1,339,236.00 |

注:总申购份额含因份额升降级、二级市场买入等导致的强制强增份额。总赎回份额含因份额升降级、二级市场卖出等导致的强制调减份额。

§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 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,自2015年4月3日起,本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。详情请见2015年4月4日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富收益快钱货币市场基金募集的文件;
2、《汇添富收益快钱货币市场基金基金合同》;
3、《汇添富收益快钱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、报告期内收益快钱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。

9.2 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

9.3 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4月21日